

编号: {}

华夏基金龙腾稳健 1 号集合资产管理计划 资产管理合同

资产管理人：华夏基金管理有限公司

资产托管人：中国建设银行股份有限公司上海市分行

二〇二三年九月

中国建设银行
骑缝

目 录

一、前言	2
二、释义	5
三、声明与承诺	8
四、当事人及权利义务	11
五、资产管理计划的基本情况	19
六、资产管理计划的募集	23
七、资产管理计划的成立与备案	25
八、资产管理计划的参与、退出与转让	27
九、份额持有人大会及日常机构	35
十、资产管理计划份额的登记	35
十一、资产管理计划的投资	36
十二 投资顾问（如有）	41
十三 分级安排（如有）	42
十四 利益冲突及关联交易	42
十五、投资经理的指定与变更	46
十六、资产管理计划的财产	47
十七、投资指令的发送、确认和执行	51
十八、交易及交收清算安排	55
十九、越权交易	61
二十、资产管理计划财产的估值和会计核算	66
二十一、资产管理计划的费用与税收	74

二十二、资产管理计划的收益分配	79
二十三、信息披露与报告	79
二十四、风险揭示	82
二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算	92
二十六、反洗钱	98
二十七、违约责任	100
二十八、争议的处理	101
二十九、资产管理合同的效力	101
三十、其他事项	103
附件一：华夏基金龙吟稳健沪享 1 号集合资产管理计划托管账户指令（样本）	107
附件二：划款指令授权书（样本）	108
附件三：业务联系表	109

华夏基金
2023-09-19&wamny

资产委托人承诺书

1、资产委托人已仔细阅读并知悉《华夏基金龙腾稳健1号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”）、计划说明书、风险揭示书的全部内容。

2、资产委托人保证委托财产的来源及用途符合中华人民共和国法律法规的相关规定，保证自身进行本合同项下投资具有合法性，资产委托人以其管理的资产管理产品投资于本资产管理计划的，资产委托人保证投资于本资产管理计划不违反其自身产品法律文件约定的投资范围、投资比例及投资限制等。资产委托人确认自身及其产品投资人（如有）为法律法规等规定的合格投资者，其产品投资人（如有）中不包含任何资产管理产品，承诺投资本计划未违反多层嵌套、杠杆约束等任何法律法规及监管规定，资产委托人承诺未使用贷款、发行债券募集的非自有资金投资本计划。资产委托人充分知晓本计划的投资范围、投资限制、投资策略，并保证委托财产投资于本合同约定的投资品种及本合同项下的投资限制不违反任何适用的法律法规、监管规定、行业规则等。

3、资产委托人承诺向资产管理人或代销机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资比例及限制和风险承受能力等基本情况及相关材料真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。

4、资产委托人确认认可资产管理人或代销机构对其投资者资格及相应风险承受与识别能力的认定，确认自身风险承受能力与本资产管理计划风险收益特征相匹配。资产委托人承诺在进行投资者认定过程中所提供信息及相关材料真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导，如有重要信息变化足以影响其投资者认定结果时及时告知资产管理人或代销机构。如资产委托人因不按照规定提供相关信息，或提供的信息不真实、不准确、不完整的，资产委托人依法自行承担相应法律责任，资产管理人有权利终止产品销售或相关业务服务的提供。

5、资产委托人已充分理解委托财产投资将可能面临包括但不限于下列各项风险：市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险、操作或技术风险、证券交易资金前端控制风险、税收风险、特定的投资方法及委托资产所投资的特定

投资对象可能引起的特别风险、资产管理计划未完成备案的风险、资产委托人本金部分或全部损失的风险、募集失败风险、关联交易和利益冲突风险以及其他风险。

6、资产委托人了解所投资品种的风险收益特征，已充分考虑自身的风险承受能力，愿意承担相应的投资风险。

7、资产委托人承认，资产管理人、资产托管人、代销机构未对委托财产的本金和收益状况作出任何承诺或担保，本合同约定的业绩报酬计提基准（如有）仅用于计提资产管理人的业绩报酬，不构成资产管理人的保证。

8、资产委托人了解，资产管理人按照约定管理和运用委托财产，但不保证委托财产本金不受损失，也不保证最低收益。

9、资产委托人承认，签署本合同是经资产委托人独立决策作出，符合资产委托人自身的业务决策程序要求。

10、资产委托人承认，如发生任何触发法律法规规定及监管机构要求的信息披露义务的事项，本人（或机构）将按照法律法规规定及监管机构的要求自行履行信息披露义务。

11、资产委托人承诺不得利用未公开信息进行交易、内幕交易、操纵市场、进行不公平交易和从事各种形式的利益输送等违法违规行为，也不得要求资产管理人或通过资产管理计划从事任何违法违规行为。

资产委托人(签字或盖章):

日期: 年 月 日

一、前言

(一) 订立本合同的目的、依据和原则

1、订立本资产管理合同(以下简称“本合同”或“合同”)的目的是为了明确投资者、资产管理人和资产托管人在开展集合资产管理业务过程中的权利、义务及职责。

2、订立本合同的依据是《中华人民共和国民法典》(以下简称“《民法典》”)、《中华人民共和国证券法》(以下简称“《证券法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(以下简称“《管理办法》”)、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(以下简称“《运作规定》”)、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引(试行)》和其他有关法律法规。

3、订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护本合同各方当事人的合法权益。

(二)本合同的当事人包括投资者、资产管理人和资产托管人。投资者自签订本合同且依据本合同取得资产管理计划份额,即成为资产管理计划的投资者和本合同的当事人。在本合同存续期间,投资者自全部退出资产管理计划之日起,该投资者不再成为资产管理计划的投资者和本合同的当事人。资产管理人应当对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向证券投资基金业协会进行备案。

证券投资基金业协会接受本资产管理计划的备案不能免除资产管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露产品信息的法律责任,也不代表证券投资基

金业协会对资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断。投资者应当自行识别产品投资风险并承担投资行为可能出现的损失。

二、释义

在本合同中，除上下文另有规定外，下列用语应具有如下含义：

（一）资产管理计划、本计划、计划：指华夏基金龙腾稳健 1 号集合资产管理计划，系本合同下资产管理人向符合条件的多个投资者销售的，由中国建设银行股份有限公司上海市分行担任资产托管人，用以取得符合条件的多个投资者资产管理计划财产并集合于特定账户进行投资的计划

（二）计划说明书：指《华夏基金龙腾稳健 1 号集合资产管理计划计划说明书》

（三）风险揭示书：指《华夏基金龙腾稳健 1 号集合资产管理计划风险揭示书》

（四）资产管理合同、本合同、合同：指投资者、资产管理人和资产托管人签署的《华夏基金龙腾稳健 1 号集合资产管理计划资产管理合同》及其附件，以及对该合同及附件做出的任何有效变更

（五）投资者、委托人：指签订了资产管理合同且依据本合同取得资产管理计划份额的投资人

（六）资产管理人：指华夏基金管理有限公司

（七）资产托管人：指中国建设银行股份有限公司上海市分行

（八）法律法规：指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件

- (九) 中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- (十) 证券投资基金业协会：指中国证券投资基金业协会
- (十一) 中国结算：指中国证券登记结算有限责任公司
- (十二) 银行间市场登记结算机构：指中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司
- (十三) 证券交易所：指上海证券交易所/深圳证券交易所
- (十四) 注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。本计划的注册登记机构为华夏基金管理有限公司
- (十五) 交易日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
- (十六) 工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
- (十七) 开放日：投资者可以参与或退出本计划的工作日
- (十八) 销售机构：指资产管理人或资产管理人委托的销售机构
- (十九) T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)
- (二十) 证券账户：指根据中国证监会有关规定和中国结算相关业务规则，由资产托管人或资产管理人为本计划在中国结算开立的证券账户，在银行间市场登记结算机构开立的债券托管账户
- (二十一) 资金账户、托管账户：指资产托管人根据有关规定为资产管理计划开立的、专门用于资金收付、清算交收的银行账户
- (二十二) 资产管理计划财产、委托财产：指投资者拥有合法所有权或处分权、委托资产管理人管理并由资产托管人托管的、作为本合同标的的财产
- (二十三) 资产管理计划资产总值：指资产管理计划拥有的各类证券、银行存款本息及其他投资的价值总和

(二十四) 资产管理计划资产净值：指资产管理计划资产总值减去负债后的价值

(二十五) 资产管理计划资产估值：指计算评估资产管理计划资产和负债的价值，以确定资产管理计划资产净值的过程

(二十六) 本合同生效日、资产管理计划成立日：指本计划的募集金额缴足之日起十个工作日内，资产管理人将募集到的全部资金存入托管账户，并由资产管理人公告资产管理计划成立之日

(二十七) 认购：指在资产管理计划初始募集期间，资产委托人按照本合同的约定购买本计划份额的行为

(二十八) 参与：指在资产管理计划开放日，资产委托人按照本合同的规定参与本计划份额的行为

(二十九) 退出：指在资产管理计划开放日，资产委托人按照本合同的规定退出本计划份额的行为

(三十) 违约退出：指资产委托人在非合同约定的退出开放日退出资产管理计划的行为。本计划不接受违约退出

(三十一) 元：指人民币元

(三十二) 不可抗力：指不能预见、不能避免并不能克服的客观情况，且在本合同由合同当事人签署之日后发生的，使本合同当事人无法全部履行或无法部分履行本合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、系统故障、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

(三十三) 损失：本合同及附件、补充协议中的损失均指直接损失。

三、声明与承诺

(一) 投资者声明

1.符合《运作规定》合格投资者的要求,向资产管理人或销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法,不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更,及时书面告知资产管理人或销售机构。

资产委托人确认在签署本合同前已签署相应的风险揭示书,委托人理解风险揭示书中所述内容,愿意承担本计划可能存在的风险与后果。资产委托人理解委托财产的投资、运作、托管面临本合同第二十四部分中列举的各类风险,资产管理人及资产托管人就委托财产面临的前述固有风险免于承担责任。

资产委托人承诺及保证:符合法律法规、监管机构及自律组织对于本计划投资者的各项要求,包括但不限于:

(1) 资产委托人具备相应风险识别能力和风险承担能力,为符合要求的合格投资者:1)具有2年以上投资经历,且满足下列三项条件之一的自然人:家庭金融净资产不低于300万元,家庭金融资产不低于500万元,或者近3年本人年均收入不低于40万元;2)最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位;3)依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构,包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、商业银行理财子公司、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构;4)接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品;5)基本养老金、社会保障基金、年金基金等养老基金,慈善基金等社会公益基金,合格境

外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；6）中国证监会视为合格投资者的其他情形。

2.财产的来源及用途符合国家有关规定，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理计划，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。

3.已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓资产管理人、资产托管人及相关机构不对资产管理计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险。

4. 资产委托人在此同意并授权：管理人为实现资产管理合同服务之目的或其他资金管理、经营管理的需求，或根据相关法律法规及监管要求，有权自主决定对委托人个人信息（范围包括但不限于个人的姓名、身份证号、认购信息、账户信息等合理范围内的信息）/机构信息（范围包括但不限于机构名称、证件号、认购信息、账户信息等合理范围内的信息）以及资产管理合同的相关信息进行合理范围内的收集、使用、处理，范围包括但不限于：（1）根据法律、法规、证券交易所规则、税务机关、政府机关、法院或仲裁机构要求披露；（2）为投资运营管理的必要需求，根据资产管理合同管理人、托管人、注册登记机构、投资顾问（如有）、销售机构（如有）、证券经纪服务机构（如有）等机构的要求向其披露；（3）为资产管理合同投资运营管理的必要需求，向律师事务所（如有）、会计师事务所（如有）、资产评估（如有）和（或）税务等其他专业顾问披露；（4）其他为实现合同目的而合理收集、使用、处理个人信息的情形。

（二）资产管理人承诺

1.在签订本合同前充分向投资者说明了有关法律法规和相关投资工具的运作市场及方式，并充分揭示了相关风险。

2.已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对投资者的财务状况进行了充分评估。

3.按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用委托财产，不保证委托财产一定盈利，也不保证最低收益或本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。

4.根据《中华人民共和国反洗钱法》等反洗钱相关法律法规要求履行反洗钱义务，包括但不限于客户身份识别、客户身份资料和交易记录保存、大额交易和可疑交易报告。并为资产托管人开展反洗钱工作提供充分的协助，法律法规另有规定的除外。

（三）资产托管人承诺

1.按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管委托财产，履行信义义务以及本合同约定的其他义务。

2.根据法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会的规定和资产管理合同的约定，对资产管理人的投资或清算指令等进行监督。

3.在资产管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照法律法规及合同约定召集份额持有人大会（如有），维护投资者权益，份额持有人大会设立日常机构的除外。

4.资产托管人对委托财产的保管，并非对委托财产本金或收益的保证或承诺，资产托管人不承担委托财产的投资风险。

5.根据《中华人民共和国反洗钱法》等反洗钱相关法律法规要求履行反洗钱

义务，包括但不限于客户身份识别、客户身份和交易资料留存、大额和可疑交易报告。并为资产管理人开展反洗钱工作提供充分的协助，法律法规另有规定的除外。

四、当事人及权利义务

（一）投资者

指依据集合资产管理合同和集合计划说明书参与本集合计划的投资者。资产管理计划应当设定为均等份额，除资产管理合同另有约定外，每份份额具有同等的合法权益。投资者的详细情况在合同签署页列示。

（二）资产管理人

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区安庆大街甲3号院

法定代表人：杨明辉

联系人：王素君

联系电话：010-88066004

（三）资产托管人

名称：中国建设银行股份有限公司上海市分行

住所：上海市淮海中路200号

通讯地址：上海市陆家嘴环路900号

负责人：刘军

授权代理人：房师新

联系人：王丰

联系电话：021-58880000-1070

（四）投资者的权利

根据法律法规及其他有关规定，投资者的权利包括：

- 1、分享资产管理计划财产收益；
- 2、取得分配清算后的剩余资产管理计划财产；
- 3、按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；
- 4、根据本合同的规定，参加或申请召集资产管理计划份额持有人大会（如有），行使相关职权；
- 5、按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的信息披露资料；
- 6、监督资产管理人、资产托管人履行投资管理及托管义务的情况；
- 7、法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。

（五）投资者的义务

根据法律法规及其他有关规定，投资者的义务包括：

- 1、认真阅读并遵守资产管理合同，保证投资资金的来源及用途合法；
- 2、接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承受能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；
- 3、承诺投资资产管理计划的最终资金来源不存在为贷款、发行债券等筹集的非自有资金的情形；除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应向资产管理人充分披露实际投资者和最

终资金来源；

4、认真阅读并签署风险揭示书；

5、按照资产管理合同约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担资产管理合同约定的管理费、业绩报酬（如有）、托管费、审计费、税费等合理费用；

6、在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；

7、向资产管理人或资产管理计划销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合资产管理人或其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；

8、不得违反资产管理合同的约定干涉资产管理人的投资行为；

9、不得从事任何有损资产管理计划及其投资者、资产管理人管理的其他资产及资产托管人托管的其他资产合法权益的活动；

10、保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等；不得利用资产管理计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动；

11、配合资产管理人在反洗钱方面对投资者的尽职调查、资金来源和用途合法性审查、可疑交易调查和报告；

12、法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务。

（六）资产管理人的权利

根据法律法规及其他有关规定，资产管理人的权利包括：

1、按照资产管理合同约定，独立管理和运用资产管理计划财产；

- 2、按照资产管理合同约定，及时、足额获得资产管理人管理费用及业绩报酬（如有）；
- 3、按照有关规定和资产管理合同约定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利；
- 4、根据资产管理合同及其他有关规定，监督资产托管人，对于资产托管人违反资产管理合同或有关法律法规规定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告相关监管机构；
- 5、自行提供或者委托经中国证监会、证券投资基金业协会认定的服务机构为资产管理计划提供募集、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务，并对其行为进行必要的监督和检查；
- 6、以资产管理人的名义，代表资产管理计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；
- 7、法律法规、中国证监会、证券投资基金业协会规定的及资产管理合同约定的其他权利。

（七）资产管理人的义务

根据法律法规及其他有关规定，资产管理人的义务包括：

- 1、依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜；
- 2、按照证券投资基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息；
- 3、按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用资产管理计划财产；
- 4、对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金；

- 5、制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；
- 6、配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划财产；
- 7、建立健全的内部管理制度，保证本资产管理计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、资产管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理，分别记账，分别投资；聘请投资顾问的，应制定相应利益冲突防范机制；
- 8、除依据法律法规、资产管理合同及其他有关规定外，不得为资产管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作资产管理计划财产；
- 9、保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等，依法依规提供信息的除外；
- 10、公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动；
- 11、除规定情形或符合规定条件外，不得为资产管理人、资产托管人及其关联方提供融资；
- 12、按照资产管理合同约定接受投资者和资产托管人的监督；
- 13、以资产管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 14、召集资产管理计划份额持有人大会（如有），份额持有人大会设立日常机构的除外；
- 15、按照资产管理合同约定计算并向投资者报告资产管理计划份额净值；
- 16、确定资产管理计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和合同的约定；

- 17、按照资产管理合同约定负责资产管理计划会计核算并编制财务会计报告
- 18、聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；
- 19、按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；
- 20、根据法律法规与资产管理合同的规定，编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告，并报告相关监管机构（如需）；
- 21、办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 22、建立并保存投资者名单；
- 23、组织并参加资产管理财产清算小组，参与资产管理财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 24、按照法律、行政法规和中国证监会的规定，保存资产管理计划的会计账册、妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；
- 25、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会并通知资产托管人和投资者；
- 26、资产管理人应按照《中华人民共和国反洗钱法》等有关反洗钱的法律法规和监管要求履行反洗钱义务，包括但不限于委托人身份识别、委托人身份和交易资料留存、资金来源和用途合法性审查、大额可疑交易报告、制裁筛查等，并为资产托管人开展反洗钱工作提供充分的协助，法律法规另有规定的除外；
- 27、除必要的披露及监管要求外，不得以资产托管人的名义做营销宣传；
- 28、保证向投资者支付的受托资金及收益返回其参与资产管理计划时使用

的结算账户或其同名账户；

29、法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他义务。

（八）资产托管人的权利

根据法律法规及其他有关规定，资产托管人的权利包括：

- 1、按照资产管理合同的约定，及时、足额获得资产管理计划托管费用；
- 2、根据资产管理合同第十九章及其他法律法规有关规定，监督资产管理人对资产管理计划财产的投资运作，对于资产管理人违反本合同的行为，对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的情形，有权报告中国证监会并采取必要措施；
- 3、按照资产管理合同的约定，依法保管资产管理计划财产；
- 4、投资者或资产管理人在反洗钱上拒绝配合合法性审查、可疑交易调查等情况的，资产托管人保留终止合作的权利；
- 5、法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。

（九）资产托管人的义务

根据法律法规及其他有关规定，资产托管人的义务包括：

- 1、安全保管资产管理计划财产；
- 2、除依据法律法规规定和资产管理合同的约定外，不得为资产托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产；
- 3、对所托管的不同财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立；

- 4、公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动；
- 5、按规定开立和注销资产管理计划的托管账户及其他投资所需账户；
- 6、复核资产管理计划资产净值和份额净值；
- 7、办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项；
- 8、根据相关法律法规和资产管理合同约定，复核资产管理人编制的资产管理计划财产的定期报告，并出具书面意见；
- 9、编制资产管理计划的年度托管报告，并报告相关监管机构（如需）；
- 10、按照法律法规要求和资产管理合同约定，根据资产管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- 11、资产管理人未按规定召集或者不能召集份额持有人大会（如有）的，由资产托管人召集份额持有人大会，份额持有人大会设立日常机构的除外；
- 12、保守商业秘密，除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外，不得向他人泄露；
- 13、根据法律、行政法规和中国证监会的规定保存资产管理计划资产管理的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；
- 14、监督资产管理人的投资运作，发现资产管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或资产管理合同约定的，有权拒绝执行，立即通知资产管理人并报告中国证监会相关派出机构；
- 15、国家有关法律法规、监管机构及资产管理合同规定的其他义务。

五、资产管理计划的基本情况

（一）资产管理计划的名称

华夏基金龙腾稳健 1 号集合资产管理计划

（二）资产管理计划的类别

固定收益类集合资产管理计划

（三）资产管理计划的运作方式

定期开放式

（四）资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级

1、投资目标

在严格控制投资风险的前提下，追求委托资产的稳健增值。

2、主要投资方向及投资比例

资产管理计划根据《运作规定》组合投资的要求进行投资，具体投资范围如下：

本计划主要投资于固定收益类金融工具，包括：

（1）现金。

（2）期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单。

（3）剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券、资产支持票据。

（4）货币市场基金。

（5）中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许资产管理计划投资其他品种且符合本产品

投资目标的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

【投资比例与限制】

(1) 本计划投资于固定收益类资产的比例不低于资产管理计划总资产的 80%；资产委托人同意，在本计划存续期间，为规避特定风险，本计划投资于固定收益类资产的比例可以低于资产管理计划总资产的 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产的 80%。“特定风险”主要指因市场剧烈波动、特定类别资产风险收益特征发生重大变化等因素对本资产管理计划产生不利影响的风险。

(2) 本计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净值的 25%；管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。

(3) 本计划投资单一债券规模不超过该债券总规模的 25%，且占本计划净值的比例不超过 10%。

(4) 本计划不得投资于债项评级和主体评级均未达到 AA+ 的债券，其中短期债项评级不低于 A-1 级，无债项评级的参考主体评级，评级机构以管理人认定为准。

(5) 本计划的总资产占净资产的比例不超过 200%。资产管理计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50% 的，该资产管理计划的总资产不得超过其净资产的 120%。资产管理计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种不受前述规定限制。

(6) 如本计划为每季度多次开放的, 主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不超过资产管理计划资产净值的 20%。

(7) 本计划的开放退出期内, 资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值, 不低于计划资产净值的 10%。

(8) 本计划不投资于资产支持证券劣后级、资产支持票据劣后级。

(9) 本计划不投资于除公募基金以外的其他资产管理产品。

(10) 法律法规、中国证监会以及资产管理合同规定的其他投资限制。

非因资产管理人主观因素导致突破前述比例限制的, 资产管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个交易日内调整至符合要求。法律法规或监管部门取消或变更上述限制, 以最新法律法规或监管要求为准。

3、产品风险等级

本计划投资风险等级为【R1】, 属于【低风险】等级。适合于专业投资者及风险识别、评估、承受能力【C1-保守型】及以上的普通投资者, 本计划投资者应同时符合合格投资者要求。

(五) 资产管理计划的存续期限

除本合同另有约定外, 本合同有效期自合同生效之日起至满 120 个月的对日止 (若该日非交易日的, 顺延至下一交易日)。

(六) 资产管理计划份额的募集面值

资产管理计划每份募集面值为 1.00 元。

(七) 资产管理计划的最低资产要求

本计划发行总规模不低于 1,000 万元。

(八) 资产管理计划的分级安排 (如有):

(九) 资产管理计划的份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务机构，本计划的份额登记、估值与核算、信息技术系统服务机构皆为华夏基金管理有限公司。

(十) 预警、止损安排

本计划委托财产份额净值预警线为 0.98 元，止损线为 0.96 元。

本计划预警线为【0.98】元。在任一估值核对日（T 日），根据委托资产的估值，计划资产份额净值小于或者等于【0.98】元时，则本资产管理计划触及预警线，资产管理人应于 T+1 日以邮件或电话的形式通知资产委托人。

本计划止损线为【0.96】元。在任一估值核对日（T 日），根据委托资产的估值，计划资产份额净值小于或者等于【0.96】元时，资产管理人应自 T+1 交易日起对计划所持有的可变现的资产进行变现操作。如遇所持证券处于流通受限期，则资产管理人应于解禁之后二十个交易日内对所持有的可变现的资产进行变现操作。直至本计划的资产全部变现，本计划提前结束。

资产委托人确认，上述预警线、止损线仅是资产管理人采取相应措施的起点，在资产管理人进行预警、止损操作后，本计划份额净值仍可能低于预警线、止损线。上述预警线、止损线不构成资产管理人对于本计划本金及收益情况的任何承诺或保证。

(十一) 其他需要订明的内容。

除本合同另有约定外，资产管理计划应当设定为均等份额，每份计划份额具有同等的合法权益。

六、资产管理计划的募集

（一）资产管理计划的初始募集

本计划初始募集期自本计划份额发售之日起不得超过 60 天。

初始募集的具体时间由资产管理人根据相关法律法规以及本合同的规定确定，并在计划说明书中披露。

（二）资产管理计划的募集方式

本计划由资产管理人自行销售或通过资产管理人委托的具有基金销售资格的销售机构向投资者销售。销售机构具体名单见计划说明书。

投资者参与本计划，必须与资产管理人和资产托管人签订资产管理合同，按销售机构规定的方式缴足参与资金。参与资金的具体金额和份额以注册登记机构的确认结果为准。

（三）资产管理计划的募集对象

参与本计划的投资者投资于本计划的初始金额不低于 100 万元（不含参与费用），且具备相应风险识别能力和风险承受能力的自然人、法人或者其他组织（不包括私募资产管理产品）：

1、具有 2 年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元；

2、最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；

3、依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、商业银行理财子公司、金融资产投资公司、信托

公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；

4、中国证监会视为合格投资者的其他情形。

法律法规、监管机构、自律组织对于合格投资者认定将来另有规定的，从其规定。

（四）资产管理计划的最低认购金额和支付方式

认购资金应以现金形式交付。

投资者在初始募集期间的认购金额不得低于【100】万元人民币（不含认购费用，且为【1】万元的整数倍），并可多次认购，初始募集期间追加认购金额不低于【1】万元，且为【1】万元的整数倍。

（五）资产管理计划份额的认购费用

本资产管理计划认购费率为：【0】%。

认购份额及认购费用的计算方法如下：

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=（净认购金额+认购期利息（如有））/1.00

认购份额及认购费用的计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入资产管理计划财产。

（六）初始募集期的认购程序

1、资产管理人委托代理销售机构进行募集的，可以委托代理销售机构代为完成投资者尽职调查工作，并将相关资料提供给资产管理人。

2、认购程序。资产委托人办理认购业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

3、认购申请的确认。

销售机构受理认购申请并不表示对该申请是否成功的确认,而仅代表销售机构确实收到了认购申请。申请是否有效应以注册登记机构的确认并且资产管理合同生效为准。投资者应在本合同生效后到各销售网点查询最终确认情况和有效认购份额。

认购申请一经受理,不得撤销。

(七) 初始认购资金的管理及利息处理方式

资产管理人应当将资产管理计划初始募集期间客户的认购资金存入资产管理计划募集结算专用账户,在资产管理计划成立前,任何机构和个人不得动用。投资者的认购参与资金(不含认购费用)在初始募集期间发生的利息收入(如有)将在初始募集期结束后折合成计划份额,归资产委托人所有。利息转份额以注册登记机构的记录为准。

(八) 投资者参与本计划应提交的文件和办理的手续等事项,在遵守本合同和计划说明书的前提下,以各销售机构的具体规定为准。

(九) 资产管理人应当将资产管理计划募集期间投资者参与资金募集资金账户,在资产管理计划成立前,任何机构和个人不得动用。

销售机构委托募集账户等信息由销售机构自行披露,销售机构联系方式以计划说明书或公告登载为准。

七、资产管理计划的成立与备案

(一) 资产管理计划成立的条件

1、资产管理计划初始资产管理计划财产金额合计不低于 1,000 万元；

- 2、投资者人数不少于 2 人，不超过 200 人；
- 3、募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定。

（二）资产管理计划的成立

募集期届满，具备上述条件的，资产托管人应当于本计划募集金额缴足并已足额划转至托管账户当日向基金管理人出具资金到账证明，资产管理人应当自本计划的募集金额缴足之日起 10 个工作日内，由资产管理人公告本资产管理计划成立。资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。

（三）资产管理合同的生效

自资产管理人公告本计划成立之日起，资产管理合同生效。投资者的认购参与资金（不含认购费用）加计其在初始募集期形成的利息将折算为相应的资产管理计划份额归投资者所有，其中利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

（四）资产管理计划的备案

资产管理人应在资产管理计划成立起 5 个工作日内报证券投资基金业协会备案。

资产管理人应当自资产管理合同变更之日起/资产管理计划终止之日起/资产管理计划清算结束后，五个工作日内报证券投资基金业协会备案。

本资产管理计划完成备案前，可以以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种。

本计划成立后需在基金业协会进行备案。即使本计划成立，并不意味着本计划必然能获得基金业协会的备案。本计划的备案面临监管政策变更等风险以及备

案信息、材料被基金业协会要求补正或调整的风险。如本资产管理计划备案信息、材料经补正后仍不符合基金业协会要求，则可能面临根据基金业协会的要求进行整改规范，届时资产管理人将就相关整改安排与资产委托人、资产托管人进行协商，必要时各方签署补充协议。如无法完成整改或各方未能达成一致的，则资产管理人有权提前终止本计划，届时资产管理人将对资产管理计划进行清算，资产管理计划财产可能产生投资损失或丧失投资机会，由此直接影响资产委托人参与本计划的投资目的。

（五）资产管理计划募集失败的处理方式

募集期届满，资产管理计划未达到成立条件的，资产管理人应当：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在募集期届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

八、资产管理计划的参与、退出与转让

（一）参与和退出场所

本计划的参与和退出将通过资产管理人或资产管理人委托的销售机构进行。

（二）参与和退出的开放日和时间

自本计划成立之日起，资产管理计划每周开放三次计划份额的参与及退出，开放日为每周一、周二和周三，如遇非工作日不开放，且不顺延。每个开放日资产管理计划开放参与及退出，具体办理时间为开放期内上海证券交易所、深圳证券交易所正常交易日的交易时间。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，资产

管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并告知投资者。

（三）临时开放期的触发条件、程序及披露等相关安排

在合同变更或法律法规、监管规则变更时，为保障委托人选择退出资产管理计划的权利，本计划可设置临时开放期，临时开放期仅开放退出、不开放参与。临时开放期的具体时间安排以管理人届时公告为准。

（四）参与和退出的方式、价格及程序及确认等

1、“未知价”原则，即资产管理计划的参与和退出价格以开放日当日的资产管理计划份额净值为基准进行计算。

2、资产管理计划采用金额参与和份额退出的方式，即参与以金额申请，退出以份额申请。

3、资产委托人办理参与、退出等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

4、当日的参与和退出申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销。

5、参与和退出申请的确认。销售网点受理参与和退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了参与或退出申请。参与申请采取时间优先、金额优先原则进行确认，退出申请按先进先出的方式处理。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。注册登记机构应在法律法规规定的时限内对资产委托人参与、退出申请的有效性进行确认。资产委托人应在一个开放周期结束后至各销售网点查询最终确认情况。

6、参与和退出申请的款项支付。参与采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则参与不成功，则为无效申请，已交付的款项将退回资产委托人

指定资金账户。资产委托人退出申请成交后,资产管理人应按规定向资产委托人支付退出款项,原则上退出款项自确认之日起5个工作日内划往资产委托人银行账户,本合同另有约定的除外。在发生巨额退出时,退出款项的支付办法按本合同和有关法律法规规定处理。

7、资产管理人在不损害资产委托人权益的情况下可更改上述原则,但最迟应在新的原则实施前3个工作日告知资产委托人。资产管理人提前3个工作日在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

(五)参与和退出的金额限制

投资者在资产管理计划存续期开放日购买资产管理计划份额的,单笔购买金额应不低于100万元人民币(不含参与费用);资产委托人追加购买资产管理计划份额的,追加金额应为1万的整数倍。委托人在资产管理计划存续期开放日购买资产管理计划份额的,应符合合格投资者标准,且参与金额应满足本资产管理计划最低参与金额限制(不含参与费用),已持有资产管理计划份额的投资者在资产管理计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的除外。

当投资者持有的计划资产净值高于100万元人民币时,投资者可以选择全部或部分退出资产管理计划;选择部分退出资产管理计划的,投资者在退出后持有的计划资产净值不得低于100万元人民币。当资产管理人发现投资者申请部分退出资产管理计划将致使其在部分退出申请确认后持有的计划资产净值低于100万元人民币的,资产管理人有权适当减少该投资者的退出金额,以保证部分退出申请确认后投资者持有的计划资产净值不低于100万元人民币。当投资者持有的计划资产净值低于100万元人民币(含100万元人民币)时,需要退出计划的,投资者必须选择一次性全部退出资产管理计划。

在符合上述规定的前提下，资产管理人可根据市场情况，合理调整对参与金额和退出份额的数量限制。资产管理人在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

（六）参与和退出的费用

本资产管理计划不收取参与和退出费用。

（七）参与份额的计算方式、退出金额的计算方式

1、参与份额的计算方法：

参与份额=参与金额/参与申请受理当日集合计划单位净值

2、退出金额的计算方法

退出金额=退出份额×退出申请受理当日集合计划单位净值-退出份额对应的业绩报酬（如有）。

（八）拒绝或暂停参与、暂停或延缓退出的情形及处理

1、在如下情况下，资产管理人可以拒绝接受投资者的参与申请：

（1）资产管理计划份额持有人达到 200 人。

（2）根据市场情况，资产管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对资产管理计划业绩产生负面影响，从而损害现有资产委托人的利益的情形。

（3）因资产管理计划收益分配、或资产管理计划内某个或某些证券进行权益分派等原因，使资产管理人认为短期内接受参与可能会影响或损害现有资产委托人利益的。

（4）资产管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害其他资产委托人利益的。

（5）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

资产管理人决定拒绝接受某些资产委托人的参与申请时,参与款项将退回资产委托人账户。

2、在如下情况下,资产管理人可以暂停接受投资者的参与申请:

- (1) 因不可抗力导致无法受理资产委托人的参与申请。
- (2) 证券交易场所交易时间临时停市,导致资产管理人无法计算当日资产管理计划资产净值。
- (3) 发生本资产管理计划合同规定的暂停资产管理计划资产估值情况。
- (4) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

资产管理人决定暂停接受全部或部分参与申请时,应当告知资产委托人。在暂停参与的情形消除时,资产管理人应及时恢复参与业务的办理并予以告知资产委托人。资产管理人在其网站公告上述事项即视为履行告知义务。

3、在如下情况下,资产管理人可以暂停或延缓接受资产委托人的退出申请或延缓支付退出款项:

- (1) 因不可抗力导致资产管理人无法支付退出款项。
- (2) 证券交易场所交易时间临时停市,导致资产管理人无法计算当日资产管理计划资产净值。
- (3) 发生本资产管理计划合同规定的暂停资产管理计划资产估值的情况。
- (4) 连续两个或两个以上开放日发生巨额退出。
- (5) 委托资产因停牌、处于锁定期或限售期、流动性等客观原因无法变现,或者资产变现将使计划净值产生较大波动从而影响份额持有人利益的。
- (6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的,资产管理人应当及时告知资产委托人。在暂停退出的

情况消除时，资产管理人应及时恢复退出业务的办理并及时告知资产委托人。资产管理人在其网站公告上述事项即视为履行告知义务。

发生上述情形之一的，已确认的退出申请，原则上资产管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个退出申请人申请量占退出申请总量的比例分配给退出申请人，未支付部分可延期支付。

（九）巨额退出的认定及处理方式

1、巨额退出的认定

资产管理计划的净份额退出申请超过上一日资产管理计划总份额的 20%，为巨额退出。

2、巨额退出的处理方式

出现巨额退出时，资产管理人可以根据本资产管理计划当时的资产状况决定接受全额退出或部分延期退出。

（1）接受全额退出：当资产管理人认为有能力支付资产委托人的全部退出申请时，按正常退出程序执行。

（2）部分延期退出：当资产管理人认为支付资产委托人的退出申请有困难，或认为支付资产委托人的退出申请进行的资产变现可能使计划资产净值发生较大波动时，资产管理人在当日接受退出比例不低于上一日计划总份额 20%的前提下，对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，应当按单个委托人申请退出份额占当日申请退出总份额的比例，确定该委托人当日受理的退出份额；未受理部分除委托人在提交退出申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的退出申请不享有退出优先权，退出价格为下一个开放日的价格，以此类推，直到全部退出为止。

当本计划发生巨额退出并采取部分延期退出时,资产管理人应当及时告知资产委托人。资产管理人在其网站公告上述事项即视为履行告知义务。

(十) 份额转让

本集合计划暂时不支持份额的转让。

在条件允许的情况下,在集合计划存续期间,投资者可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式,向合格投资者转让其持有的集合资产管理计划份额,份额转让应遵守交易场所相关规定及要求,并按规定办理份额变更登记手续。受让方首次参与集合计划,应先与管理人、托管人签订资产管理合同。转让后,持有本集合计划份额的合格投资者合计不得超过二百人。若本计划后续支持份额转让业务,管理人将通过网站公告的方式及时向投资者披露集合计划份额可以办理转让业务的信息,具体办理时间及业务流程参照管理人公告。

(十一) 非交易过户的认定及处理方式

资产管理计划的非交易过户是指登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本资产管理计划份额的投资人。

继承是指资产委托人死亡,其持有的计划份额由其合法的继承人继承;捐赠指委托人将其合法持有的计划份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体;司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将委托人持有的计划份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供注册登记机构要求提供的相关资料,对于符合条件的非交易过户申请按注册登记机构的规定办理,并按注册登记机构规定的标准收费。

(十二) 资产管理人以自有资金参与资产管理计划的条件、方式、金额、比例以及管理人自有资金退出的条件。

资产管理人有权以自有资金参与本计划,但资产管理人并无义务以自有资金参与本计划。资产管理人以自有资金投资本资产管理计划的,资产管理人自有资金参与份额不承担任何风险补偿责任,与资产委托人所持的份额享有同等权益、承担同等风险。

资产管理人以自有资金参与、退出本计划的,应当提前 5 个工作日告知资产委托人和资产托管人,并取得其同意。资产管理人通过公告、邮件或征询意见函等方式就资产管理人自有资金参与、退出事宜向资产委托人、资产托管人征询意见。资产委托人、资产托管人应及时关注资产管理人网站公告、邮件或征询意见函发送情况。资产委托人、资产托管人在公告、邮件或征询意见函等规定期限内未回复意见的,视同资产委托人、资产托管人同意。资产管理人及其子公司以自有资金在初始募集期参与本计划的,资产委托人、资产托管人签署本资产管理合同即视为同意该参与事项。

资产管理人及其子公司以自有资金参与本计划的,持有期限不得少于六个月。

资产管理人及其子公司以自有资金参与本计划的份额合计不得超过本计划总份额的 50%。因本计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的,资产管理人应当依照中国证监会规定及本合同的约定及时完成调整。法律法规、监管机构及自律组织另有规定的,从其规定。

(十三) 资产管理人应定期将资产管理计划投资者变更情况报送证券投资基金业协会。

九、份额持有人大会及日常机构

本计划不设份额持有人大会。

十、资产管理计划份额的登记

（一）资产管理计划注册登记业务

本计划的注册登记业务指本计划登记、存管、清算和结算业务，具体内容包括投资者账户建立和管理、份额注册登记、资产管理计划销售业务的确认、清算及交易确认、发放红利、建立并保管份额持有人名册等。

全体资产管理计划份额持有人同意资产管理人、份额登记机构或其他份额登记义务人将集合资产管理计划投资者名称、身份信息以及集合资产管理计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。

（二）资产管理计划注册登记业务办理机构

本资产管理计划的注册登记机构为华夏基金管理有限公司。

（三）注册登记机构履行如下职责：

- 1、建立和保管资产委托人账户资料、交易资料、资产管理计划客户资料表等。
- 2、配备足够的专业人员办理本资产管理计划的注册登记业务。
- 3、严格按照法律法规和本资产管理合同规定的条件办理本资产管理计划的注册登记业务。
- 4、严格按照法律法规和本资产管理合同的规定计算业绩报酬（如有）。
- 5、妥善保存登记数据，并将资产管理计划投资者名称、身份信息以及资产

管理计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自资产管理计划账户销户之日起不得少于 20 年。

6、对资产委托人的账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对资产委托人或资产管理计划带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但法律法规或监管机构另有规定的除外。

7、按本资产管理计划合同，为资产委托人提供资产管理计划收益分配等其他必要的服务。

8、在法律法规允许的范围内，制定和调整注册登记业务的相关规则。

9、法律法规规定的其他职责。

十一、资产管理计划的投资

（一）投资目标

在严格控制投资风险的前提下，追求委托资产的稳健增值。

（二）投资范围及比例

资产管理计划根据《运作规定》组合投资的要求进行投资，具体投资范围如下：

本计划主要投资于固定收益类金融工具，包括：

（1）现金。

（2）期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单。

（3）剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券、资产支持票据。

(4) 货币市场基金。

(5) 中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许资产管理计划投资其他品种且符合本产品投资目标的,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

【投资比例限制】

(1) 本计划投资于固定收益类资产的比例不低于资产管理计划总资产的 80%;资产委托人同意,在本计划存续期间,为规避特定风险,本计划投资于固定收益类资产的比例可以低于资产管理计划总资产的 80%,但不得持续 6 个月低于计划总资产的 80%。“特定风险”主要指因市场剧烈波动、特定类别资产风险收益特征发生重大变化等因素对本资产管理计划产生不利影响的风险。

(2) 本计划投资于同一资产的资金,不得超过本计划资产净值的 25%;管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金,不得超过该资产的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。

(3) 本计划投资单一债券规模不超过该债券总规模的 25%,且占本计划净值的比例不超过 10%。

(4) 本计划不得投资于债项评级和主体评级均未达到 AA+ 的债券,其中短期债项评级不低于 A-1 级,无债项评级的参考主体评级,评级机构以管理人认定为准。

(5) 本计划的总资产占净资产的比例不超过 200%。资产管理计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50% 的,该资产管理计

划的总资产不得超过其净资产的 120%。资产管理计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种不受前述规定限制。

(6) 如本计划为每季度多次开放的, 主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不超过资产管理计划资产净值的 20%。

(7) 本计划的开放退出期内, 资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值, 不低于计划资产净值的 10%。

(8) 本计划不投资于资产支持证券劣后级、资产支持票据劣后级。

(9) 本计划不投资于除公募基金以外的其他资产管理产品。

(10) 法律法规、中国证监会以及资产管理合同规定的其他投资限制。

非因资产管理人主观因素导致突破前述比例限制的, 资产管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个交易日内调整至符合要求。法律法规或监管部门取消或变更上述限制, 以最新法律法规或监管要求为准。

(三) 投资策略

本计划采用的主要策略包括:

本集合计划根据宏观经济运行状况、政策形势、信用状况、利率走势、资金供求变化等的综合判断, 并结合各类资产的流动性特征、风险收益、估值水平特征, 决定组合资产在现金、利率债、同业存单、银行存款、逆回购等各类资产的配置比例, 并适时进行动态调整。

(四) 投资决策依据

投资决策依据集合计划以法律法规规定及本合同约定的有关规定为决策依据, 并以维护集合计划投资者利益作为最高准则。具体决策依据包括:

1、《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》等法律法规的规定以及集合资产管理合同、说明书的约定；

2、国内外经济形势及变化趋势等；

3、投资对象收益和风险的匹配关系，本计划将在充分权衡投资对象的风险和收益的前提下做出投资决策。

（五）投资决策程序

投资程序分为投资决策、投资执行、投资跟踪与反馈、投资核对与监督、合规与风险控制等环节。

（六）投资管理方法及投资标准

1、具备明确的投资目标，包括产品的投资规模、投资方向、投资结构、投资成本与收益等；

2、准备多只投资备选的可行方案，审慎选择；

3、充分考虑实践运作中可能产生的风险，控制并降低风险；

4、充分考虑公司自身的投资能力范畴，包括公司的风险承受能力、现金流缺口状况等。

（七）投资禁止

投资禁止行为：

1、承销证券；

2、违反规定向他人贷款或者提供担保；

3、从事承担无限责任的投资；

4、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

5、直接投资于商业银行信贷资产；

6、违规为地方政府及其部门提供融资，要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；

7、直接或者间接投资法律、行政法规和国家政策禁止投资的行业或领域；

8、直接或者间接投资于违反国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外）；

9、法律法规、监管机构、自律组织禁止的其他活动。

如果法律法规或监管部门对上述限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，则本计划投资不再受相关限制。

（八）建仓期；

本资产管理计划的建仓期为 6 个月。资产管理人应当自本合同生效之日起 6 个月内使本资产管理计划的投资组合比例符合本合同的有关约定。在上述期间内，本资产管理计划的投资范围、投资策略应当符合本合同的约定。

（九）预警、止损安排本计划委托财产份额净值预警线为 0.98 元，止损线为 0.96 元。

本计划预警线为【0.98】元。在任一估值核对日（T 日），根据委托资产的估值，计划资产份额净值小于或者等于【0.98】元时，则本资产管理计划触及预警线，资产管理人应于 T+1 日以邮件或电话的形式通知资产委托人。

本计划止损线为【0.96】元。在任一估值核对日（T 日），根据委托资产的估值，计划资产份额净值小于或者等于【0.96】元时，资产管理人应自 T+1 交易日起对计划所持有的可变现的资产进行变现操作。如遇所持证券处于流通受限期，则资产管理人应于解禁之后二十个交易日内对所持有的可变现的资产进行变现操作。直至本计划的资产全部变现，本计划提前结束。

资产委托人确认,上述预警线、止损线仅是资产管理人采取相应措施的起点,在资产管理人进行预警、止损操作后,本计划份额净值仍可能低于预警线、止损线。上述预警线、止损线不构成资产管理人对于本计划本金及收益情况的任何承诺或保证。

(十) 业绩比较基准

本计划无业绩比较基准。

(十一) 风险收益特征

本产品为固定收益类资产管理产品,属于【R1-低风险】投资品种,适合于专业投资者及风险识别、评估、承受能力【C1-保守型】及以上的普通投资者,本计划投资者应同时符合合格投资者要求。

(十二) 投资比例超限的处理方式及流程

因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等资产管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的,资产管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的,资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。法律法规或监管部门取消或变更上述限制,以最新法律法规或监管要求为准。

(十三) 投资的资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配。

十二 投资顾问(如有)

本计划无投资顾问。

十三 分级安排（如有）

本计划不设分级安排。

十四 利益冲突及关联交易

（一）关联交易及利益冲突情形

1、关联方范围

本资产管理计划的关联方包括：

- （1）资产管理人；
- （2）资产托管人；
- （3）资产管理人的控股股东、实际控制人；
- （4）资产托管人的控股股东、实际控制人；
- （5）与资产管理人有重大利害关系的公司；
- （6）与资产托管人有重大利害关系的公司；
- （7）法律法规、监管规定、自律规则认定的其他关联方。

2、重大关联交易和一般关联交易的划分标准

（1）重大关联交易

本资产管理计划的重大关联交易包括但不限于：

- ①一级市场申购资产管理人、资产托管人及其关联方发行或承销的股票、可转换债券；
- ②二级市场交易资产管理人、资产托管人及其关联方发行的股票、可转换债券，当日单券交易金额合计超过前一估值日组合净资产 1%且在 500 万元以上的；

③一级市场申购资产管理人、资产托管人及其关联方发行或承销的债券（不含可转换债券）、资产证券化产品，当日单券申购金额合计超过前一估值日组合净资产 5%且在 1000 万元以上的；

④二级市场交易资产管理人、资产托管人及其关联方发行的债券（不含可转换债券）、资产证券化产品，当日单券交易金额（以面值计算）合计超过前一估值日组合净资产 5%且在 1000 万元以上的；

⑤法律法规、监管规定、自律规则规定的其他重大关联交易。

(2)一般关联交易

本资产管理计划的一般关联交易包括但不限于：

①投资资产管理人、资产托管人及其关联方发行或承销的老股东配售（配股、配债等公司行为）；

②二级市场交易资产管理人、资产托管人及其关联方发行的股票、可转换债券，当日单券交易金额合计占前一估值日组合净资产 1%以内或不超过 500 万元（含）的；

③一级市场申购资产管理人、资产托管人及其关联方发行或承销的债券（不含可转换债券）、资产证券化产品，当日单券申购金额合计占前一估值日组合净资产 5%以内或不超过 1000 万元（含）的；

④二级市场交易资产管理人、资产托管人及其关联方发行的债券（不含可转换债券）、资产证券化产品，当日单券交易金额（以面值计算）合计占前一估值日组合净资产 5%以内或不超过 1000 万元（含）的；

⑤与资产管理人及其关联方、资产托管人进行股票大宗交易、固定收益类投资标的的二级市场现券询价交易、逆回购交易；

⑥逆回购质押券为资产管理人及其关联方、资产托管人发行的证券；

⑦开立资产管理人及其关联方、资产托管人的交易席位、期货账户、海外交易账户；

⑧投资资产管理人及其关联方、资产托管人发行的公募基金、私募资产管理计划；

⑨法律法规、监管规定、自律规则规定的其他关联交易。

3、关联交易审批程序

资产管理人按照其公司制度履行关联交易内部审批程序。对于资产管理人公司制度要求进行内部审批的关联交易，由投资部门就相关关联交易进行审批，风险管理部负责投资合规性审核，交易管理部负责交易执行。

4、关联交易特别风险提示

提示资产委托人注意：虽然资产管理人积极遵循资产委托人利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作，但仍可能因资产管理人运用资产管理计划财产从事关联交易被监管部门认为存在利益输送、内幕交易的风险，进而可能影响资产委托人的利益。关联交易涉及的证券价格可能会出现下跌，从而使本计划收益下降，甚至带来本金损失。此外，资产管理人运用计划财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使，进而可能影响委托财产的投资收益。

对于一般关联交易，资产委托人签署合同即视为同意本资产管理计划从事一般关联交易，资产管理人无需就具体一般关联交易另行取得资产委托人的个别授权和同意，资产委托人主要通过信息披露文件事后了解一般关联交易信息，存在无法及时知悉相关交易的风险。对于重大关联交易，虽然资产管理人将通过合同

约定方式就具体重大关联交易向资产委托人征询意见,但仍然存在资产委托人未
及时关注到资产管理人意见征询信息,从而影响资产委托人行使相关权利的风险。

(二) 关联交易及利益冲突的应对及处理

1、资产委托人知悉并同意,资产委托人签署本合同即视为同意本资产管理
计划从事前述一般关联交易,资产管理人无需就具体一般关联交易另行取得资产
委托人的个别授权和同意,但该等一般关联交易投资应按照市场通行的方式和条
件参与,公平对待委托财产,并依据相关要求履行信息披露义务。

2、本资产管理计划参与重大关联交易的,应当取得资产委托人同意,并依
据相关要求履行信息披露义务。

资产管理人通过邮件或征询意见函等方式就具体重大关联交易向资产委托
人征询意见。资产委托人应及时关注资产管理人邮件或征询意见函等发送情况。
资产委托人应在邮件或征询意见函等指定的日期内按指定的形式回复书面意见。
具体安排如下:

(1) 资产委托人在邮件或征询意见函等规定期限内未回复意见的,视同资
产委托人同意,资产管理人不再另行通知。

(2) 资产委托人明确回复不同意的,本资产管理计划将不进行该笔重大关
联交易。

(3) 资产委托人回复意见但意见不明确的,则视为该资产委托人不同意,
按照第(2)条资产委托人不同意的方式处理。

3、资产管理计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的,资产管理人应当
坚持资产委托人利益优先原则,从充分维护资产委托人利益角度积极处理该等利
益冲突情形,防范利益输送等违法违规行为。在发生该等利益冲突时,资产管理

人应当视具体利益冲突情形选择在向资产委托人提供的定期报告或临时报告中披露，具体披露内容包括利益冲突情形、处置方式、对资产委托人利益的影响等。

(三)关于本章节约定的关联方范围、重大关联交易和一般关联交易的划分标准等，如法律法规另有规定、监管机构另有要求或资产管理人公司制度发生变更的，资产管理人可以按照法律法规、监管要求和公司制度调整相关内容并按本合同约定告知资产委托人，无需履行合同变更程序，资产管理人通过在其网站发布公告等方式告知即视为履行告知义务。

十五、投资经理的指定与变更

(一) 投资经理的指定

1、资产管理计划投资经理由资产管理人负责指定。本投资经理不得兼任资产管理人所管理的证券投资基金的基金经理。

2、本计划财产投资经理为闫麒合；

现任华夏基金机构债券投资部投资经理，2013年7月毕业于清华大学五道口金融学院。2013年加入华夏基金，曾任华夏基金管理有限公司交易管理部债券交易员、投资研究部固定收益研究员。目前主要负责银行委托专户、基本养老保险持有至到期利率产品、货币型养老金的投资运作。擅长进行流动性管理及杠杆运作，注重风险控制。投资风格稳健，通过结合多因素研判宏观经济走势，把握货币政策和资金面走势，提升组合盘活收益。债券投资更多为组合提供安全垫，通过杠杆策略增厚收益。整体而言，闫麒合在组合流动性管理、杠杆应用、风险控制、获取利差、波段套利以及战略择时上，都表现出较好的投资能力。

本计划投资经理已经依法取得基金从业资格，具有三年以上投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验，具备良好的诚信记录和职业操守，且最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

（二）投资经理的变更

资产管理人可以根据需要变更投资经理，投资经理变更后，资产管理人应及时通知资产委托人及资产托管人。资产管理人在其网站就投资经理变更事宜进行相应公告，即视为已经履行了相应告知程序。投资经理发生变更时，原任投资经理应当妥善保管投资业务资料，及时办理投资经理业务的移交手续，新任投资经理应当及时接受。

十六、资产管理计划的财产

（一）资产管理计划财产的保管与处分

1、资产管理计划财产的债务由资产管理计划财产本身承担责任，投资者以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。

2、资产管理计划财产独立于资产管理人、资产托管人的固有财产，并独立于资产管理人管理的和资产托管人托管的其他财产。资产管理人、资产托管人不得将资产管理计划财产归入其固有财产。

3、资产管理人、资产托管人因资产管理计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入资产管理计划财产。

4、资产管理人、资产托管人可以按照本合同的约定收取管理费、托管费以及本合同约定的其他费用。资产管理人、资产托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对资产管理计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。资产管理人、

资产托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，资产管理计划财产不属于其清算财产。

5、资产管理计划财产产生的债权不得与不属于资产管理计划财产本身的债务相互抵销。非因资产管理计划财产本身承担的债务，资产管理人、资产托管人不得主张其债权人对资产管理计划财产强制执行。上述债权人对资产管理计划财产主张权利时，资产管理人、资产托管人应明确告知资产管理计划财产的独立性，采取合理措施并及时通知投资者。

6、资产托管人对在中国结算开立的证券账户、在银行间市场登记结算机构开设的债券托管账户中的证券和在资产托管人开立的资金账户内的资金负有保管职责，因中国结算和银行间市场登记结算机构自身原因造成资产损失的，按照不可抗力进行处置。因资产管理人投资运作注册登记在中国结算和银行间市场登记结算机构以外机构的证券，以及在资产托管人以外开立的银行账户内的资金，由资产托管人保管资产管理人提供的相关凭证，资产管理人对该凭证的真实性、合法性、有效性、完整性负责；实际存管在交易对手、中介机构等其他机构的证券和存放在资产托管人以外银行账户内的资金，对该等证券或资金的任何损失，资产托管人不承担任何责任。

7、资产托管人未经资产管理人的指令，不得自行运用、处分、分配资产管理计划财产的任何资产（不包含资产托管人依据中国结算结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行或交易/登记结算机构扣收交易费、结算费和账户维护费等费用）。

8、对于因为资产管理计划财产投资产生的应收资产，应由资产管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知资产托管人，到账日应收资产没有到达资产托

管人处的，资产托管人应及时通知资产管理人采取措施进行催收，由此给资产管理计划财产造成损失的，资产管理人应负责向有关当事人追偿损失，资产托管人对此不承担任何责任。

（二）资产管理计划财产相关账户的开立和管理

资产托管人按照有关规定开立资产管理计划的托管账户及其他投资所需账户，投资者和资产管理人应当在开户过程中给予必要的配合，并提供所需资料和开户费用。证券账户的持有人名称应当符合资产托管人或中国结算最新账户管理规定。

1、托管资金账户

账户的开设与管理由资产托管人根据管理人的书面委托，按照相关法律、法规和有关规定和有关业务规则办理。托管资金账户名称应为本资产管理计划的名称（具体以开立为准）。银行托管账户不得提现，不得通兑，不得透支，银行托管账户项下不得购买本票、汇票、支票等可流通票据。资产管理人委托资产托管人负责办理银行托管账户项下资金的划拨。除支付账户开户费、账户管理费、网银开户费、网银服务费和银行结算手续费可以由银行托管账户开户行自行扣收外，资产管理人使用银行托管账户中的资金，必须事先向资产托管人发送划款指令，经资产托管人审核无误后方能划款。银行托管账户项下预留印鉴按资产托管人要求办理，由资产托管人刻制、保管及使用。资产管理人同意并委托资产托管人与托管账户开户机构完成账户对账单核对工作。托管账户开户机构无需寄送纸质对账单给资产管理人核对。

2、交易所证券账户

资产托管人根据中国结算的规定为本资产管理计划开设证券账户。证券账户

的开户费由资产管理人先行垫付，资产管理人可向资产托管人发送划款指令，将垫付的开户费从资产管理计划托管账户中扣还资产管理人。账户注销时，在遵守中国结算的相关规定下，由资产管理人和资产托管人协商确认主要办理人，由其负责注销本计划项下的证券账户。账户注销期间，主要办理人如需另一方提供配合的，另一方应予以配合。

证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本资产管理计划业务的需要。资产托管人和资产管理人不得出借或未经对方同意擅自转让资产管理计划的任何证券账户，亦不得使用资产管理计划的任何账户进行本资产管理计划业务以外的活动。

若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则资产托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

3、银行间市场相关账户

《资产管理合同》生效后，资产管理人负责以资产管理计划的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表资产管理计划进行交易；资产托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，在银行间市场登记结算机构开立债券账户和资金结算账户，并代表资产管理计划进行银行间市场债券的结算。资产管理人代表本计划签订全国银行间债券市场债券回购主协议。资产管理计划财产进入银行间债券市场从事资产管理业务前，资产管理人应提前通知资产托管人，提供所需资料和开户费用。资产托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，在银行间市场登记结算机构开立债券账户和资金结算账户，并代表资产管理计划进行银行间市场债券的结算。资产管理人

负责以资产管理组合的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表资产管理组合进行交易。

4、场外开放式基金账户

场外开放式基金账户由资产管理人根据基金公司要求填写相关资料后开立。资产管理人应指定托管资金账户作为开放式基金交易及回款的唯一结算账户。资产管理人应及时将开放式基金账户的信息发送资产托管人。

资产管理人选择通过机构投资者场外投资业务平台（简称“FISP”）参与开放式基金投资的，应由资产管理人在 FISP 系统登记产品信息，由资产托管人对银行账户信息进行验证。产品登记成功后，由投资资产管理人在线向基金销售机构提交开户申请，账户开立信息通过 FISP 反馈资产管理人和资产托管人。

5、资产管理人投资股指期货之前，应与资产托管人、期货公司三方共同就股指期货开户、清算、估值、交收、费用等事宜另行签署《期货投资托管操作三方备忘录》。

6、其他事项

以上相关账户的开立和使用，仅限于满足本资产管理计划投资需要，资产管理人、资产托管人两方均不得出借和转让，亦不得使用上述账户从事本合同规定以外的活动。

其它暂未涉及的账户之管理参照上述规定，未尽事宜届时另行商处。

十七、投资指令的发送、确认和执行

（一）交易清算授权

本合同签署生效后，资产管理人应向资产托管人提供《授权代表签字与印鉴

样本通知书》(以下简称“授权文件”),内容包括被授权人名单、预留印鉴及被授权人签字或签章样本,授权文件应注明被授权人相应的权限及有效时限,并规定资产管理人向资产托管人发送指令时资产托管人确认被授权人身份的方法,授权文件应加盖单位公章。

资产托管人在收到授权文件原件并经资产管理人电话确认后,授权文件即生效。如果授权文件中载明具体生效时间的,该生效时间不得早于资产托管人收到授权文件并经电话确认的时点。如早于,则以资产托管人收到授权文件并经电话确认的时点为授权文件的生效时间。

资产管理人和资产托管人对授权文件负有保密义务,其内容不得向被授权人及必要操作人员以外的任何人泄露。但法律法规规定或有权机关要求的除外。

(二) 投资指令的内容

投资指令是资产管理人在运用资产管理计划财产时,向资产托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。资产管理人发给资产托管人的指令应与明款项事由、支付时间、金额、收付款账户信息等,按授权文件加盖预留印鉴并由被授权人签字。

(三) 投资指令的发送、确认及执行时间与程序

指令由被授权人代表资产管理人用传真的方式或其他资产托管人和资产管理人协商一致的方式向资产托管人发送。资产管理人有义务在发送指令后及时与资产托管人进行电话确认。资产托管人依照授权文件规定的方法确认指令有效后,方可执行指令。对于被授权人发出的指令,资产管理人不得否认其效力。资产管理人应按照有关法律法规和本合同的规定,在其合法的经营权限和交易权限内发送划款指令,被授权人应按照其授权权限发送划款指令。

对于要求当天到账的指令，必须在当天 15:00 前向资产托管人发送并确认，15:00 之后发送的，资产托管人尽力执行，但不能保证划账成功。如果要求当天某一时点到账的指令，则指令需要至少提前 2 个工作小时发送（工作小时是指每个工作日上午 9:00-11:30 和下午 13:00-17:00，下同），并且相关付款条件已经具备，资产托管人视付款条件具备时为指令送达时间。对于中国结算实行 T+0 非担保交收的业务，资产管理人应在交易日 14:00 前将划款指令发送至资产托管人。因资产管理人过错原因导致指令传输不及时，致使资金未能及时划入中国结算指定交收账户给托管人造成的损失由资产管理人承担。资产管理人应确保资产托管人在执行指令时，托管资金账户有足够的资金余额，在资金头寸充足的情况下，资产托管人对资产管理人符合法律法规、本合同要求的指令不得拖延或拒绝执行。

资产托管人收到资产管理人发送的指令后，应立即审慎验证有关内容、印鉴和签名，托管人按照中国银行业协会于 2019 年 3 月 18 日公布并施行的《商业银行资产托管业务指引》中第二十条规定，对划款指令及相关合同或文件进行审核。复核无误后应在规定期限内执行，不得延误。

（四）资产托管人依法暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序；

若资产托管人发现资产管理人的指令违反本合同约定的，有权拒绝执行，立即通知资产管理人。

（五）资产管理人发送错误指令的情形和处理程序

资产管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息，指令中重要信息模糊不清或不全等。

资产托管人发现资产管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知资产

管理人改正。如需撤销指令，资产管理人应按照托管人认可的方式进行撤销。

资产托管人因正确执行资产管理人符合本合同规定、合法合规的指令和依据交易程序已经生效的指令而对资产管理计划财产造成的损失不承担赔偿责任。

（六）更换投资指令被授权人的程序

资产管理人更换被授权人、更改或终止对被授权人的授权，应立即将新的授权文件以传真或电子邮件方式通知资产托管人，并经资产管理人电话确认后生效，原授权文件同时废止。新的授权文件在传真或电子邮件发出后五个工作日内送达文件正本。新的授权文件生效之后，正本送达之前，资产托管人按照新的授权文件传真件或电子邮件内容执行有关业务。资产托管人更换接受资产管理人指令的人员，应提前通过电话通知资产管理人。

（七）投资指令的保管

投资指令原件由资产管理人负责保管，资产托管人保管已收到的投资指令传真件或电子邮件。若原件与传真件或电子邮件不一致，以资产托管人收到的传真件或电子邮件为准。

（八）其他事项

资产管理人应在银行间交易成交后，及时将通知单、相关文件及划款指令加盖印章后发至资产托管人并电话确认，由资产托管人完成后台交易匹配及资金交收事宜。如果银行间结算系统已经生成的交易需要取消或终止，资产管理人要书面通知资产托管人。经资产管理人与资产托管人协商一致，且由资产管理人出具书面委托后，资产管理人可授权资产托管人根据外汇交易中心发送的成交数据，在中债综合业务平台或上海清算所综合业务系统自行完成交易确认操作。

本计划财产在证券交易所场内交易的资金清算交割，由资产托管人通过中国

结算上海分公司/深圳分公司及清算代理银行办理。资产托管人视中国结算向其发送的清算数据为有效指令，无须资产管理人向资产托管人另行出具划款指令。

本计划财产资金账户发生的银行结算费用、银行账户维护费等银行费用，由资产托管人直接从资金账户中扣划，无须资产管理人出具划款指令。

十八、交易及交收清算安排

本产品参与交易所场内证券投资，采取托管人结算模式，资产管理人与资产托管人应根据有关法律法规及相关业务规则，签订《托管银行证券资金结算协议》用以具体明确资产管理人与资产托管人在证券交易资金结算（含港股通）业务中的程序与责任。协议签署前，资产管理人应按资产托管人要求配合提供相应准入材料。

资产管理人、资产托管人应遵守本合同下述（一）和（二）之约定。

（一）选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

资产管理人负责选择代理本计划财产证券买卖的证券经营机构，并和被选中的证券经营机构签订委托协议，使用其交易单元作为资产管理计划财产的交易单元。资产管理人应提前十个工作日书面通知资产托管人，并依据资产托管人要求提供相关资料，以便资产托管人申请办理接收结算数据手续。

资产管理人应及时将资产管理计划财产交易单元专用号、佣金费率等基本信息以及变更情况以书面形式通知资产托管人。

（二）投资证券后的清算交收安排

1、结算备付金与保证金

中国结算分别于每月前 6 个交易日及每月前 3 个交易日内，对结算参与人

最低备付金限额与结算保证金限额进行重新核算、调整。资产托管人应分别于每月前 3 个交易日内及结算保证金调整当日通过《资金账户报告》通知资产管理人本计划最低备付金调整金额以及调整后的结算保证金金额。资产管理人应预留最低备付金和结算保证金,并根据中国结算确定的实际最低备付金、结算保证金数据为依据安排资金运作,调整所需的现金头寸。如因调整最低备付金、结算保证金后造成透支,资产管理人应视资产托管人最低结算备付金比例计收方式分别于下列时点补足透支金额:

(1) 固定备付金比例计收方式下,资产管理人应在调整最低备付金、结算保证金当日上午 11:00 之前补足金额。

(2) 差异化备付金比例计收方式下,资产管理人应最晚于资金交收日 8:30 前补足金额

2、清算交收

资产托管人负责资产管理计划财产买卖证券交易的清算交收。证券交易所场内资金结算由资产托管人根据中国结算结算数据办理;其他场外资金汇划由资产托管人根据资产管理人的资金划款指令具体办理。

如果因为资产托管人自身原因在清算上造成资产管理计划财产的直接损失,应由资产托管人负责赔偿,但因中国人民银行、中国结算和银行间市场登记结算机构资金结算系统以及其他机构的结算系统发生故障等非资产托管人的过错造成清算资金无法按时到账的情形,资产托管人免责;如果因为资产管理人过错原因未事先通知资产托管人增加交易单元等事宜,致使资产托管人接收数据不完整,造成清算差错的责任由资产管理人承担;如果因为资产管理人过错原因未事先通知需要单独结算的交易,造成资产管理计划资产损失的由资产管理人承担;资产

管理人应采取合理措施，确保在 T 日日终有足够的资金头寸用于 T+1 日中国结算的资金交收。如因资产管理人过错原因导致资金头寸不足，资产管理人应视资产托管人最低结算备付金比例计收方式分别于下列时点补足透支金额：

（1）固定备付金比例计收方式下，资产管理人应最晚于资金交收当日上午 11：00 之前补足金额。

（2）差异化备付金比例计收方式下，资产管理人应最晚于资金交收日 8：30 前补足金额

如果资产管理人未遵循上述规定备足资金头寸，影响了计划资产自身的清算交收及资产托管人与中国结算之间的一级交收，由此给资产托管人、本资产管理计划财产造成的损失由资产管理人负责。

如果由于资产管理人违反市场操作规则的规定进行超买、超卖及质押券欠库等原因造成资产管理计划财产投资清算困难和风险的，资产托管人在预清算结束后应通知资产管理人预透支和预欠库事项，资产管理人应保持联系方式畅通，后续补缴等事宜由资产管理人负责解决，由此给资产托管人、本资产管理计划财产造成的损失由资产管理人承担。

根据中国结算结算规定，资产管理人在进行融资回购业务时，用于融资回购的债券将作为偿还融资回购到期购回款的质押券。如因资产管理人过错原因造成债券回购交收违约或因折算率变化造成质押欠库，导致中国结算欠库扣款或对质押券进行处置造成的投资风险和损失，资产托管人不承担责任。

对于中国结算实行 T+0 非担保交收的业务，资产管理人应在交易日 14:00 前将划款指令发送至资产托管人。因资产管理人过错原因指令传输不及时，致使资金未能及时划入中国结算指定交收账户给本资产管理计划和资产托管人所造

成的损失由资产管理人承担。

（三）资金、证券和期货账目及交易记录的核对

资产管理人和资产托管人每月对资产管理计划财产的证券账目、实物券账目、交易记录进行核对。

（四）资金余额的确认

资产托管人于 T+1 日上午 09:30 以前向资产管理人传真 T 日资产管理计划财产投资交易清算后的《资金账户报告》。每日日终，完成当日投资交易资金结算并核实账户资金余额后，传真《资金账户报告》进行资金余额的确认。

（五）投资银行存款的特别约定

1、资产管理人和资产托管人的职责

资产管理人应当加强对本产品投资银行存款风险的评估与研究，建立健全银行存款投资的业务流程、岗位职责、风险控制措施和监察稽核制度，严格测算与控制投资银行存款的风险敞口，针对不同类型存款银行建立相关投资限制制度，切实防范有关风险。

资产托管人负责依据资产管理人提供的银行存款投资合同/协议、投资指令、支取通知等有关文件办理资金的支付以及存款证实书的接收、保管与交付，切实履行托管职责。资产托管人负责依据本合同的约定对存款开户证实书进行保管。

2、相关协议的签署

资产管理人在投资银行存款之前，需与存款银行签订具体存款协议。具体存款协议或其他托管人认可的书面材料应包括但不限于以下内容：

（1）存款账户必须以本资产管理计划名义开立。

（2）协议须约定存款类型、期限、利率、计息方式、金额、账号、起止时

间，存款银行经办行名称、地址及进款账户。

(3) 协议须约定将资产托管人为本计划开立的托管银行账户指定为唯一回款账户，任何情况下，存款银行都不得将存款本息划往任何其他账户。

(4) 资金划转过程中存款银行需要使用过渡账户的，存款银行须保证资金在过渡账户中不出现滞留，不被挪用。

(5) 存款银行有义务保证本产品存款投资在存续期内的安全。

(6) 协议须明确，为确保资金安全，定期存款证实书需明确约定不得被质押，不得用于背书和转让；约定存款银行不得接受资产管理人或资产托管人任何一方单方面提出的对该笔存款投资进行更名、转让、挂失、质押、担保、撤销变更印鉴及回款账户信息等任何可能导致财产转移的申请。

(7) 协议须明确，存款银行对存款证实书的真实性负责，并承担移交过程中由于存款证实书丢失、损毁、被人为调换等所引发的一切后果。正常情况下，同城存款银行应在存款证实书开立后 2 个工作日内将原件移交托管行保管，异地存款银行应在存款证实书开立后 5 个工作日内将原件移交资产托管人保管。

具体内容以存款协议为准。

3、办理资产管理计划投资银行存款的开户、全部提前支取、部分提前支取或到期支取，可采取以下方式：

(1) 由资产管理人和资产托管人的授权代表持授权委托书共同全程办理，资产管理人上述事项被授权人员与资产管理人负责洽谈存款事宜并签订存款协议的人员不能为同一人。

(2) 由存款银行提供上门送、取单服务。在上门送、取单时，存款银行经办人员应携带单位介绍信/授权书以及个人身份证件，以便资产托管人进行核查。

(3) 资产管理人与资产托管人双方协商一致的其他办理方式。

4、本产品投资银行存款或办理存款支取时，资产管理人需提前发送银行存款投资合同/协议、投资指令、支取通知等有关文件到资产托管人处，以便资产托管人有足够的时间履行相应的业务操作程序。

5、如发生逾期支取，资产托管人不承担相应利息损失及逾期支取手续费。

6、本产品投资银行存款时，应本着便于存款证实书安全保管和日常监督检查的原则，尽可能选择托管账户开户行所在地的银行机构办理。

7、对于已移交资产托管人保管的存款开户证实书等实物凭证，资产托管人应确保安全保管；对未按约定将存款开户证实书等实物凭证移交资产托管人保管的，资产托管人应向资产管理人进行必要的催缴和风险提示；提示后仍不将相关实物凭证送达资产托管人保管的，出于托管履职和尽责，资产托管人可视情况采取必要的风险控制措施：(1) 建立风险预警机制，对于实物凭证未送达集中度较高的存款银行，主动发函资产管理人尽量避免在此类银行进行存款投资；(2) 在定期报告中，对未按约定送达资产托管人保管的实物凭证信息按规定范围信息披露；(3) 未送达实物凭证超过送单截止日后 30 个工作日，且累计超过 3 笔(含)以上的，部分或全部暂停配合资产管理人办理后续新增存款投资业务，直至实物凭证送达托管人保管后解除。实物凭证未送达但存款本息已安全划回托管账户的，以及因发生特殊情况由资产管理人提供相关书面说明并重新承诺送单截止时间的，可剔除不计。

(六) 托管产品通过第三方销售机构参与开放式基金投资的特别约定

本产品可以通过第三方基金销售机构渠道投资开放式基金。为维护产品持有人利益、保障资产安全，资产资产管理人应负责制订选择第三方基金销售机构的

标准和程序，并据此选择第三方销售机构。资产管理人确保所选择的销售机构在中国证监会注册取得基金销售业务资格并已成为中国证券投资基金业协会会员，符合开展前述各类产品销售业务的各项资质和要求。资产托管人仅根据资产管理人指令将资金从托管账户划往第三方销售平台账户，对于第三方基金销售机构原因给本产品造成损失的，资产托管人不承担责任。

（七）选择期货经纪机构及期货投资资金清算安排

资产管理人投资股指期货之前，应与资产托管人、期货公司三方共同就股指期货开户、清算、估值、交收、费用等事宜另行签署《期货投资托管操作三方备忘录》。本资产管理计划投资于期货发生的资金交割清算由管理人选定的期货经纪公司负责办理，托管人对由于期货交易所期货保证金制度和清算交割的需要而存放在期货经纪公司的资金不行使保管职责，管理人应在期货经纪协议或其他协议中约定由选定的期货经纪公司承担资金安全保管责任。

资产管理人办理期货线下入金业务向资产托管人发送划款指令，资产托管人审核指令要素，款项实际入金账户由资产管理人与期货经纪公司协商确定，资产管理人应制定有效的资金监控机制。

（八）若本计划/产品项下持有的资产发生非交易过户或受益权转让（财产权转出、资金转入本基金）的，管理人应及时将相关材料发送至托管人划款指令接收邮箱并通知托管人，托管人不承担转让价款未转入托管账户或不及时转入托管账户造成的损失。

十九、越权交易

（一）越权交易的界定

越权交易是指资产管理人违反本合同约定的投资范围和投资比例限制进行的投资交易行为。

资产管理人应在本合同规定的权限内运用资产管理计划财产进行投资管理，不得违反本合同的约定，超越权限从事证券投资。

（二）越权交易的处理程序

1、违反本合同投资范围规定进行的投资交易行为

资产托管人在行使监督职责时，发现资产管理人的投资指令违反本合同约定的，有权拒绝执行，立即通知资产管理人，资产管理人应以书面形式向资产托管人进行解释、举证，并提出处理方案。在期限内，资产托管人有权随时对通知事项进行复查，督促资产管理人改正；未能在限期内改正的，资产托管人应报告中国证监会相关派出机构。

资产托管人在行使监督职责时，发现资产管理人依据交易程序已经生效的指令违反本合同约定的，执行后有权立即通知资产管理人并及时报告中国证监会相关派出机构。因执行该指令造成的损失，资产托管人不承担相关责任。

资产托管人发现资产管理人可能存在违反本合同约定，但难以明确界定时，应立即通知资产管理人，资产管理人应以书面形式向资产托管人进行解释、举证，并提出处理方案。在期限内，资产托管人有权随时对通知事项进行复查，督促资产管理人改正；未能在限期内改正的，资产托管人应报告中国证监会相关派出机构。

资产管理人应向资产托管人主动报告越权交易。资产托管人有权随时对资产管理人报告的越权交易事项进行复查，督促资产管理人改正。资产管理人对资产托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，资产托管人应报告中国证监会相关

派出机构。

2、越权交易所发生的损失及相关交易费用由资产管理人负担，所发生的收益归本计划财产所有。

（三）资产托管人对资产管理人投资运作的监督

1、资产托管人对资产管理人的投资行为行使监督权

资产托管人通过预设指标和参数、获取资产估值表及外部数据信息对资产管理计划的投资范围、投资比例和投资限制进行监督。如资产托管人发现资产投资范围、投资比例和投资限制违反合同约定时，应当拒绝执行指令或在事后出具风险提示函对资产管理人进行提示，并要求资产管理人在限期内调整，未能在限期内调整的越权事项，资产托管人将再次发送风险提示函并通知委托人，对于仍未调整的情况，资产托管人不承担相关责任。

（1）资产托管人根据合同的约定，对下述资产投资范围、投资对象进行监督。

资产管理计划根据《运作规定》组合投资的要求进行投资，具体投资范围如下：

本计划主要投资于固定收益类金融工具，包括：

1）现金。

2）期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单。

3）剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券、资产支持票据。

4）货币市场基金。

5）中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许资产管理计划投资其他品种且符合本产品投资目标的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

【投资比例限制】如下：

- 1) 本计划投资于固定收益类资产的比例不低于资产管理计划总资产的 80%。
- 2) 本计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净值的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。
- 3) 本计划投资单一债券规模不超过该债券总规模的 25%，且占本计划净值的比例不超过 10%。
- 4) 本计划不得投资于债项评级和主体评级均未达到 AA+ 的债券，其中短期债项评级不低于 A-1 级，无债项评级的参考主体评级，评级机构以管理人认定为准。
- 5) 本计划的总资产占净资产的比例不超过 200%。资产管理计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50% 的，该资产管理计划的总资产不得超过其净资产的 120%。资产管理计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种不受前述规定限制。
- 6) 本计划不投资于资产支持证券劣后级、资产支持票据劣后级。
- 7) 本计划不投资于除公募基金以外的其他资产管理产品。

非因资产管理人主观因素导致突破前述比例限制的，资产管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个交易日内调整至符合要求。法律法规或监管部门取消或变更上述限制，以最新法律法规或监管要求为准。

(2) 越权交易的例外

非因资产管理人主动投资行为导致的下列不符合投资政策的情形不构成本章所述越权交易，应当属于被动超标：

1) 由于资产管理人之外的原因导致的投资比例出现不符合本合同约定的投资政策的情形（包括但不限于证券市场波动、上市公司合并、已投资持有的证券在持有期间信用评级下降、上市公司受到监管机关处罚或谴责、上市公司股票被特别处理、上市公司年度财务审计报告未被出具标准无保留意见等，视投资政策中的具体约定而确定），为被动超标，不属于越权交易。发生被动超标时，资产管理人应在相应证券可交易之日起 20 个交易日内进行调整，以达到投资政策的要求。

2) 法律法规对被动超标另有规定的从其规定。

3) 因被动超标而对资产管理计划财产的损失由资产管理计划财产承担。

(3) 资产托管人对资产管理计划财产投资限制的监督和检查自本合同生效之日起开始。

2、投资比例限制如需变更，资产管理人应与投资者、资产托管人达成一致，完成合同变更或签订补充协议等程序，并应为资产托管人调整监督事项留出必要的时间。

3、资产托管人投资监督的准确性和完整性受限于证券经纪商及其他中介机构提供的数据和信息，合规投资的最终责任在资产管理人。

对根据交易规则，资产托管人只能在事后发现的越权交易，资产托管人通过发送投资监督报告的方式通知资产管理人，资产托管人不对该越权交易导致的委托财产损失承担赔偿责任。资产托管人无投资责任，对任何资产管理人的投资行

为(包括但不限于其投资策略及决定)或其投资回报不做承诺与担保。

二十、资产管理计划财产的估值和会计核算

(一) 估值目的

资产管理计划资产估值的目的是客观、准确地反映资产管理计划资产是否保值、增值,依据经资产管理计划资产估值后确定的资产管理计划资产净值而计算出的资产管理计划份额净值,是计算资产管理计划参与和退出价格的基础。

(二) 估值时间

本计划的估值日为每个交易日。资产管理人每交易日(T日)对该交易日(T日)的资产管理计划财产进行估值。

(三) 估值程序

资产管理人应于每个交易日将当天的估值结果以电子对账或其他双方认可的方式发送给资产托管人。资产托管人对净值计算结果复核后,当天以电子对账或其他双方认可的方式传送给资产管理人。

(四) 估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1)交易所上市的有价证券(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(2) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种, 选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值;

(3) 交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种, 选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值;

(4) 交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券, 实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价; 实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价;

(5) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券, 采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券, 采用估值技术确定公允价值;

(6) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券, 对存在活跃市场的情况下, 应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值; 对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下, 应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值; 对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下, 应采用估值技术确定其公允价值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股, 按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值; 该日无交易的, 以最近一日的市价(收盘价)估值;

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证, 采用估值技术确定公允价值。

(3) 在发行时明确一定期限限售期的股票, 包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等, 不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票, 按监

管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价估值。对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，采用估值技术确定其公允价值。

4、对于含投资人回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间采用第三方估值机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价估值。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

5、证券投资基金：

（1）非上市基金估值：

1）境内非货币市场基金，按所投资基金前一估值日的份额净值估值。

2）境内货币市场基金，按所投资基金前一估值日的万份收益计提估值日基金收益。

（2）交易所上市基金估值：

1）ETF 基金按所投资 ETF 基金估值日的收盘价估值。

2）境内上市开放式基金（LOF），按所投资基金前一估值日的份额净值估值。

3）境内上市定期开放式基金、封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值。

4）境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金前一估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按

所投资基金最近公布的万份（百份）收益计提估值日基金收益。

5) 其他证券投资基金按估值日的基金份额净值估值，当日未公布的，按其最近公布的基金份额净值为基础估值。

(3) 特殊情况处理

如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，资产管理人根据以下原则进行估值：

1) 以所投资基金的前一估值日基金份额净值估值的，若所投资基金未公布前一估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值。

2) 以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值。

3) 如果所投资基金发生分红除权、折算或拆分，资产管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

6、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

7、上述第三方估值机构提供的估值全价指第三方估值机构直接提供的估值全价或第三方估值机构提供的估值净价加每百元应计利息。

8、本计划投资股指期货、国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

9、本计划投资期权，根据相关法律法规以及监管部门的规定估值。

10、估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行公布的人民币与港币的中间价。

11、银行存款以余额列示，按商定的存款利率以当日银行营业终了的存款余额为基数在实际持有期间内逐日计提应计利息。

12、税收按照相关法律法规、监管机构等的规定以及行业惯例进行处理。

13、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

14、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

15、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

16、如资产管理人或资产托管人发现对资产管理计划财产的估值违反本合同项下订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护投资者利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

（五）估值对象

资产管理计划所拥有的金融资产及负债。

（六）估值错误的处理

1、资产管理人和资产托管人将采取必要、适当、合理的措施确保资产管理计划财产估值的准确性、及时性。当资产管理计划份额净值小数点后2位以内(含第2位)发生差错时，视为资产管理计划份额净值错误。本资产管理计划的主会计责任方由资产管理人担任，与本资产管理计划有关的会计问题，如经双方在平

等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按资产管理人的建议执行。

2、估值错误的处理原则和方法：

（1）估值错误处理原则：估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方对直接损失承担赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则有协助义务的当事人应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

（2）估值错误的处理方法：

A. 资产管理人计算的资产管理计划净值已由资产托管人复核确认，但因资产估值错误给资产委托人造成损失的，由资产管理人与资产托管人按照过错比例各自承担相应的责任。

B. 如资产管理人和资产托管人对资产管理计划净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对尚不能达成一致时，为避免不能按时披露资产管理计划净值的情形，以资产管理人的计算结果对外披露。

C. 由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致资产管理计划净值计算错误造成资产委托人的损失，以及由此造成以后交易日计划资产净值计算顺延错误而引起的资产委托人的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

（七）估值调整的情形与处理

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管

理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

相关法律法规以及监管部门有强制规定的，上述估值方法需依据规定进行调整的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

（八）暂停估值的情形

1、资产管理计划投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其它情形致使资产管理人、资产托管人无法准确评估本计划资产价值时；

3、占资产管理计划相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而资产管理人为保障投资者的利益，已决定延迟估值；

4、中国证监会和本合同认定的其它情形。

（九）资产管理计划份额净值的确认

资产管理计划资产净值是指资产管理计划资产总值减去负债后的价值。资产管理计划资产净值的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入。资产管理计划份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。

如资产管理人和资产托管人对资产管理计划份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布资产管理计划份额净值的情形，以资产管理人的计算结果对外公布，由此给投资者和资产造成的损失，资产管理人与资产托管人不负赔偿责任。

（十）特殊情况的处理

由于证券交易所及注册登记结算机构发送的数据错误或者由于其他不可抗力等，资产管理人和资产托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，

但未能发现错误的，由此造成的估值错误，资产管理人和资产托管人免除赔偿责任。但资产管理人、资产托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

（十一）资产账册的建立

资产管理人和资产托管人在本合同生效后，应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立的设置、登录和保管资产管理计划财产的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证资产管理计划财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以资产管理人的处理方法为准。

经对账发现相关各方的账目存在不符的，资产管理人和资产托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。

（十二）资产管理计划财产的会计核算

资产管理计划的会计政策比照证券投资基金现行政策约定执行。

1、会计年度、记账本位币和会计核算制度

（1）本计划财产的会计年度为每年1月1日至12月31日。

（2）记账本位币为人民币，记账单位为元。

（3）资产管理计划财产的会计核算应符合本合同、《企业会计准则》及其他法律、法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照证券投资基金的行业通行做法处理。。

2、会计核算方法

（1）资产管理人、资产托管人应根据有关法律法规和投资者的相关规定，对资产管理计划财产独立建账、独立核算。

（2）资产管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，编

制会计报表。

(3) 资产托管人应定期与资产管理人就资产管理计划财产的会计核算、报表编制等进行核对。

(4) 按照本合同约定管理人定期与托管人进行估值对账，托管人按照双方估值对账一致的结果代表本计划完成银企对账。

(5) 实收计划财产采用份额法进行核算。

二十一、资产管理计划的费用与税收

(一) 资产管理计划费用的种类

- 1、资产管理人的管理费（包括固定管理费和业绩报酬）；
- 2、资产托管人的托管费；
- 3、本计划投资金融产品发生的相关费用；
- 4、账户的资金结算汇划费、银行汇划费、账户维护费；
- 5、资产管理计划财产开立账户需要支付的费用以及证券交易费用；
- 6、资产管理计划成立后的资产管理计划信息披露费用（若有）；
- 7、资产管理计划成立后与资产管理计划有关的会计师费、审计费、律师费、仲裁费、诉讼费、保全费及为实现资产管理计划权利所产生的费用等；
- 8、按照法律法规及本合同的约定可以在资产管理计划财产中列支的其他费用。

(二) 不列入资产管理计划财产费用的项目

- 1、资产管理计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与募集有关的费用，不得在资产管理计划资产中列支。

2、资产管理人和资产托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或资产管理计划财产的损失,以及处理与本计划财产运作无关的事项或不合理事项所发生的费用等不列入资产管理计划财产运作费用。

(三) 费用计提方法、计提标准和支付方式

1、资产管理人的管理费(含税)

(1) 固定管理费

资产管理计划财产的年管理费率为 0.2%, 计算方法如下:

资产管理计划每日计提的管理费 = 本资产管理计划前一日资产净值 ×
【0.2】% / 365

产品运作首日计提的管理费按照起始运作规模为基数计算。资产管理计划财产管理费自本计划成立日起, 每日计提, 按季支付。经资产管理人申请, 资产托管人根据与资产管理人核对一致的财务数据, 自动在季初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付, 资产管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等, 支付日期顺延。

(2) 业绩报酬

(1) 业绩报酬的计提原则

1) 业绩报酬的提取频率: 业绩报酬在资产委托人全部退出或部分退出资产管理计划时及资产管理计划终止日提取。

2) 业绩报酬的计算基础: 业绩报酬以资产委托人退出时或资产管理计划终止日资产的投资增值部分高于预先设定的业绩报酬计提基准的部分为基础进行计算; 本计划业绩报酬计提基准为年收益率 2.7% (根据资产管理人发布的公告不时调整), 业绩报酬提取比例为超过业绩报酬计提基准部分的 40%。

3) 业绩报酬的计算区间：原则上根据资产委托人持有资产管理计划份额的期限分别计算业绩报酬。

(2) 业绩报酬的计算方法

业绩报酬具体计算公式如下：

$$\text{业绩报酬} = S_i \times NAV_0 \times [(NAV_1 - NAV_0) / NAV_0 - B \times T / 365] \times 40\%$$

其中：

S_i 为资产委托人每笔退出份额或资产管理计划终止时所持有的份额

NAV_0 为资产委托人每笔退出份额或资产管理计划终止时所持有份额对应的认购或参与时的份额净值

NAV_1 为退出日或资产管理计划终止日的资产管理计划份额净值

B 为资产管理计划业绩报酬计提基准，业绩报酬计提基准为年收益率 2.7%，资产管理人有权通过公告形式对业绩报酬计提基准进行调整。业绩报酬计提基准的变化，可能对资产委托人利益产生不利影响。已持有本计划份额的资产委托人，如不接受调整后的业绩报酬计提基准，有权于资产管理人所发布公告规定的开放期退出本计划；在公告规定的开放期后资产委托人继续持有本计划份额的，视为对调整后的业绩报酬计提基准无异议，业绩报酬计提基准仅用于约定计提业绩报酬的标准，不构成资产管理人对集合计划收益的承诺或保证。

T 为资产委托人每笔退出份额或资产管理计划终止时所持有份额自合同生效日或参与确认日的持有天数。

资产委托人若有多笔认购或参与，则业绩报酬按每一笔的份额明细计算后再汇总。资产委托人退出资产管理计划的，业绩报酬从退出资金中扣除；资产管理计划终止日提取业绩报酬的，业绩报酬从清算分配财产中扣除。

按上述方法计算出的业绩报酬若为负值则不提取业绩报酬。

业绩报酬由注册登记机构负责计算,资产托管人根据计算结果进行账务处理。资产管理人向资产托管人发送划款指令,资产托管人根据资产管理人指令从资产管理计划财产中一次性支付给资产管理人,指令金额以注册登记机构计算结果为准。

资产管理人指定的接收管理费的银行账户信息:

账户名称(接收管理费):华夏基金管理有限公司

账号:0200250119200003628

开户银行:工商银行北京复兴门支行

2、资产托管人的托管费(含税)

资产管理计划财产的年托管费率为 0.01%,计算方法如下:

资产管理计划每日计提的托管费 = 本资产管理计划前一日资产净值 ×
【0.01】% / 365

产品运作首日计提的管理费按照起始运作规模为基数计算。委托财产托管费自资产计划成立日(含当日)起每日计提,按季支付。经资产管理人申请,资产托管人根据与资产管理人核对一致的财务数据,自动在季初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付,资产管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

资产托管人指定收取托管费的银行账户为:

户名:托管费收入暂收暂付户

账号:3102800001563139990000000019

开户行:中国建设银行股份有限公司上海市分行

上述（一）中 3 到 8 项费用由资产托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，在费用发生时，直接列入当期费用。

（四）资产管理人和资产托管人与资产委托人协商一致后，可根据市场发展情况调高资产管理费率、资产托管费率并履行相应备案报告义务。本合同另有约定的，从其约定。各方当事人一致同意：资产管理人有权单方调低管理费率或调整（包括调低和调高）管理人业绩报酬计提基准，或者与资产托管人协商一致后调低托管费率，此等变更由资产管理人通过公告告知资产委托人、资产托管人即视为履行了信息披露义务。

（五）税收

委托财产运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律法规和税收政策执行。委托财产运作中产生的税款，由委托财产承担。相关法律法规和税收政策未规定资产管理人和/或资产托管人有代扣代缴义务的，资产管理人和资产托管人不进行代扣代缴。

鉴于资产管理人为本资产管理计划的利益投资、运用资产管理计划财产的过程中，可能因法律法规、税收政策的要求而成为扣缴义务人，就归属于本资产管理计划的投资收益、投资回报和/或本金承担扣缴义务，因此，本资产管理计划运营过程中由于上述原因发生的增值税等税负，仍由本资产管理计划的委托财产承担，届时资产管理人与资产托管人可能通过本资管计划的委托财产账户直接缴付，或划付至资产管理人账户并由资产管理人依据税务部门的要求完成税款申报缴纳。若资产管理人被税务机关要求补缴应由委托财产承担的税款的，该部分税款从委托财产中扣除；若本计划已经完成终止清算，则资产管理人有权向资产委托人就补缴的税款金额进行追偿。

二十二、资产管理计划的收益分配

本计划不进行收益分配。

二十三、信息披露与报告

（一）向投资者提供的报告

1、年度报告

资产管理人应当在每年结束后 3 个月内 编制完成资产管理计划财产年度报告，资产管理人在年度报告完成当日，将其发送资产托管人，资产托管人收到后 1 个月内完成财务数据复核，并将复核结果书面通知资产管理人，由资产管理人将年度报告送交投资者。资产管理计划成立不足 3 个月或者存续期间不足 3 个月的，资产管理人可以不编制资产管理计划当期的年度报告。年度报告包括但不限于下列信息：

- ①资产管理人履职报告；
- ②资产托管人履职报告；
- ③资产管理计划投资表现；
- ④资产管理计划投资组合报告；
- ⑤资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- ⑥资产管理计划财务会计报告；
- ⑦资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；
- ⑧资产管理计划投资收益分配情况；

⑨投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；

⑩中国证监会规定的其他事项。

2、季度报告

资产管理人应当在每季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成资产管理计划财产季度报告，资产管理人在季度报告完成当日，将其发送资产托管人，资产托管人收到后 5 个工作日内完成财务数据复核，并将复核结果书面通知资产管理人，由资产管理人将季度报告送交投资者。资产管理计划成立不足 3 个月或者存续期间不足 3 个月的，资产管理人可以不编制资产管理计划当期的季度报告。季度报告包括但不限于下列信息：

①资产管理人履职报告；

②资产托管人履职报告；

③资产管理计划投资表现；

④资产管理计划投资组合报告；

⑤资产管理计划运用杠杆情况（如有）；

⑥资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；

⑦资产管理计划投资收益分配情况；

⑧投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；

⑨中国证监会规定的其他事项。

3、资产管理计划份额净值报告

资产管理合同生效后，资产管理人每周及每个开放日至少应向投资者报告一次经资产托管人复核的计划份额净值。资产管理人披露的计划份额净值并不代

表资产委托人所能够即时获得的现金等财产金额,也不代表将来在财产分配时所能获得的分配金额,份额净值的估值及披露受限于资产管理合同约定的假设、方法及时效,不构成资产管理人或资产托管人对资产委托人委托财产本金、收益的任何保证或承诺。

4、临时报告

发生本合同约定的、可能影响投资者利益的重大事项时,资产管理人或资产托管人应当根据法律法规或本合同的规定,在事项发生之日起五日内向投资者披露:

(1) 投资经理发生变动。

(2) 涉及本资产管理计划的诉讼。

(3) 本资产管理计划的投资经理受到严重行政处罚,资产托管人及其托管部门负责人受到严重行政处罚。

(4) 中国证监会规定及本合同约定的其他事项。

5、资产管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与资产管理计划,应向投资者充分披露。

(二) 向监管机构提供的报告

资产管理人、资产托管人应当根据法律法规和监管机构的要求履行报告义务。

(三) 向资产委托人提供报告及资产委托人信息查询的方式

资产管理人向资产委托人提供的报告,将严格按照以下至少一种方式进行。在存有代销机构的情况下,资产管理人将上述信息通知到代销机构,视为已通知到资产委托人。资产委托人有义务随时与代销机构保持联系,了解有关本计划的各项信息。

1、资产管理人网站

网址：www.chinaamc.com

2、邮寄服务

资产管理人或代理销售机构向资产委托人邮寄定期报告、临时报告等有关本计划的信息。资产委托人在合同签署页上填写的通信地址为送达地址。通信地址如有变更，资产委托人应当及时通知资产管理人。

3、传真或电子邮件

如资产委托人留有传真号、电子邮箱等联系方式的，资产管理人也可通过传真、电子邮件、电报等方式将报告信息通知资产委托人。

二十四、风险揭示

本计划投资可能面临下列各项风险，包括但不限于：

（一）资产管理计划面临的一般风险

1、本金损失风险

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用计划财产，但不保证计划财产本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

在发生揭示的风险及其他尚不能预知的风险而导致本计划项下计划财产重大损失的，委托人可能发生委托本金损失的风险。

本计划的风险等级为低风险【R1】，适合专业投资者和风险识别、评估、承受能力为【C1、C2、C3、C4、C5】的普通投资者，本计划投资者应同时符合合格投资者要求。

2. 市场风险

证券、期货市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致委托财产收益水平变化，产生风险，主要包括：

（1）政策风险

因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

资产管理人作为国家有权机关监管下的金融机构，监管机构对监管政策/规定的出台和变化，可能会对本计划的投资、运作、变现将产生重大影响；本计划资产委托人同意，因资产管理人执行监管政策/规定导致资产管理合同项下全部或部分目的无法实现的，不视为违反资产管理合同的约定。

（2）经济周期风险

随经济运行的周期性变化，证券、期货市场的收益水平也呈周期性变化。委托财产投资于证券等资产，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

（3）利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。委托财产投资于证券等资产，其收益水平会受到利率变化的影响。

（4）上市公司经营风险

上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果委托财产所投资的上市公司经营不善，其证券价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使委托财产投资收益下降。虽然委托财产可以通过投资多样化来分散这种非系统

风险，但不能完全规避。

（5）购买力风险

委托财产的利润可能主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使委托财产的实际收益下降。

（6）再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券本息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，委托财产从投资的固定收益证券所得的本息收入进行再投资时，将获得比之前较少的收益率。

3、管理风险

在委托财产管理运作过程中，资产管理人的研究水平、投资管理水平直接影响委托财产收益水平，如果资产管理人对经济形势和证券、期货市场判断不准确、获取的信息不全、投资操作出现失误，都会影响委托财产的收益水平。资产管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理计划财产及资产委托人承担。资产委托人应充分知晓并承担投资运作的相关风险。

4、流动性风险

在市场流动性不足的情况下，资产管理人可能无法迅速、低成本地调整投资计划，从而对计划收益造成不利影响。资产管理计划财产要应对资产委托人的退出，如果资产管理计划财产不能迅速转变成现金，或者变现时对资产管理计划财产净值产生冲击成本，都会影响资产管理计划财产运作和收益水平。尤其是出现大额退出时，如果资产管理计划财产变现能力差，可能会产生资产管理计划财产

仓位调整的困难，导致流动性风险，从而影响资产管理计划财产收益。当发生资产管理合同约定的特定情形时，资产管理人有权暂停退出、延期退出或延期支付退出款项，该等情形的发生将可能导致资产委托人不能及时、足额获取退出款项。

5、信用风险

信用风险是指金融资产发行人未能够实现发行时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。包括：

（1）债务人违约风险

如遇金融资产发行主体信用状况恶化、信用评级下降，可能导致金融资产价格下降进而影响资产管理计划财产收益水平，若出现到期不能履行合约进行兑付的情形，可能使资产委托人遭受本金损失。

（2）交易对手方违约风险

当本计划交易对手违约时，将直接导致委托资产损失，或导致资产管理计划不能及时抓住市场机会，对投资收益产生影响。

6、关联交易及利益冲突的风险

（1）资产委托人知悉并同意，本计划可按照资产管理合同约定从事关联交易，存在关联交易的风险。资产管理人承诺关联交易应按照市场通行的方式和条件进行，资产委托人认可此等关联交易情形的存在并自愿承担相关风险。

（2）资产委托人知悉，尽管资产管理人承诺谨慎勤勉地管理委托财产，公平对待各投资组合，本计划在投资和运作过程中可能会存在一些利益冲突情形，包括但不限于：资产管理人、资产托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；资产管理人运用固有资金开展投资或者资产管理人管理的其他资管产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本计划存在相

同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；其他可能产生利益冲突的情况等。该等利益冲突可能会不利于本计划，也可能使本计划在投资运作时暂时受限，进而可能会影响收益甚至发生损失等。资产委托人认可此等情形的存在并自愿承担相关风险。对于一般关联交易，资产委托人签署合同即视为同意本资产管理计划从事一般关联交易，资产管理人无需就具体一般关联交易另行取得资产委托人的个别授权和同意，资产委托人主要通过信息披露文件事后了解一般关联交易信息，存在无法及时知悉相关交易的风险。对于重大关联交易，虽然资产管理人将通过合同约定方式就具体重大关联交易向资产委托人征询意见，但仍然存在资产委托人未及时关注到资产管理人意见征询信息，从而影响资产委托人行使相关权利的风险。

7、证券交易资金前端控制风险

根据中国证券登记结算有限责任公司、上海证券交易所、深圳证券交易所发布的证券交易资金前端风险控制相关规则，中登公司和交易所对交易参与人的全天净买入申报金额总量实施额度管理和前端控制，若资产管理人全天净买入申报金额达到或超过向交易所报送的额度信息，交易所将拒绝接受后续竞价交易买入申报，上述安排可能影响本计划的买入交易和投资操作，从而可能对本计划的收益产生影响。资产委托人确认充分知晓中登公司和交易所实施证券交易资金前端控制的相关安排。

8、操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

在计划的各种交易行为或者后台运作中,可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响,这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券注册登记机构等。

9、税收风险

根据财政部和税务总局《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值政策的通知》、《关于资管产品增值税有关问题的通知》等系列法规要求,自2018年1月1日(含)以后资管产品运营过程中发生增值税应税行为的应当缴纳增值税,上述税收由委托财产承担。税收政策的调整可能对资产管理计划的净值产生影响。

在本资产管理计划存续期间,税收征管部门可能会对增值税等应税行为的认定以及适用的税率等进行调整。届时,资产管理人将执行更新后的政策,可能会因此导致委托财产实际承担的税费发生变化。该等情况下,资产管理人有权根据法律法规及税收政策的变化相应调整税收处理,该等调整可能会影响到资产委托人的收益。由于前述税收政策变化导致对委托资产的收益影响,将由持有存续资产管理计划单位的资产委托人承担。对于现有税收政策未明确事项,本资产管理计划主要参照行业协会建议方案进行处理,可能会与税收征管认定存在差异,从而产生税费补缴及滞纳金,该等税费及滞纳金将由委托财产承担。

10、募集失败的风险

本计划的成立需符合相关法律法规的规定,本计划可能存在不能满足成立条件而无法成立的风险,资产委托人可能遭受因募集失败产生的投资机会丧失等风险。

(二)资产管理计划面临的特定风险

1、债券投资风险

利率是影响债券价格的重要因素，当利率上升时，债券价格将下跌；当利率下降时，债券的价格将上升。债券投资面临着由于市场利率波动而导致的债券价格波动风险。此外，信用债信用风险的变化、债券市场流动性不足等其他因素均可能导致债券价格的波动。债券投资面临着债券价格波动、发行主体违约等风险。

2、存款和存单投资风险

本计划可投资于银行存款、存单，本计划可能因为存款行破产、清算、拒绝或延迟兑付存款本息等存款行原因而遭受损失。对于具有固定期限的银行存款，如资产委托人在存续期内退出本资产管理计划，资产管理人可能需提前支取银行存款（如存款协议中有提前支取条款），此时提前支取部分的资金将按照协议约定的提前支取利率计算利息，该利率可能低于协议约定的到期支取利率，从而影响委托财产的收益。此外，因投资需要，可能发生需要提前支取银行存款的情形，因而可能导致利息的损失。

3、资产支持证券和资产支持票据投资风险

（1）信用风险：信用风险是指资产支持证券/票据参与主体对它们所承诺的各种合约的违约所造成的可能损失。从简单意义上讲，信用风险表现为证券化资产所产生的现金流不能支持本金和利息的及时支付而给投资者带来损失。

（2）利率风险：是指资产支持证券/票据作为固定收益证券的一种，也具有利率风险，即资产支持证券/票据的价格受利率波动发生变动而造成的风险。

（3）流动性风险：是指资产支持证券/票据不能迅速、低成本地变现的风险。

（4）提前偿付风险：是指若合同约定债务人有权在产品到期前偿还，则存在由于提前偿付而使投资者遭受损失的可能性。

(5)法律风险:是指因资产支持证券/票据交易结构较为复杂、参与方较多、交易文件较多,而存在的法律风险和履约风险。

4、基金投资风险

(1)价格波动风险,由于投资标的的价格会有波动,基金的净值也会因此发生波动。封闭式基金的价格与基金的净值之间是相关的,一般来说基本是同方向变动的,如果基金净值严重下跌,一般封闭式基金的价格也会下跌。而开放式基金的价格就是基金份额净值,开放式基金的申购和赎回价格会随着净值的下跌而下跌。所以本计划会面临基金价格变动的风险。如果基金价格下降到买入成本之下,在不考虑分红因素影响的情况下,本计划会面临亏损风险。

(2)流动性风险,对于封闭式基金而言,当要卖出基金的时候,可能会面临在一定的价格下无法卖出而要降价卖出的风险;另外,巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险,即当单个交易日基金的净赎回申请超过基金合同约定的一定比例时,本计划将可能无法及时赎回持有的全部基金份额,影响本计划的资金安排。

5、参与证券回购的风险

本计划若通过债券回购进行杠杆操作,杠杆操作可能会放大组合收益波动,对组合业绩稳定性有较大影响,同时杠杆成本波动也会影响组合收益率水平,在市场下行或杠杆成本异常上升时,有可能导致资产管理计划财产收益的超预期下降风险甚至遭受损失。资产委托人知悉,本计划用于融资回购的债券将作为资产托管人相关结算备付金账户偿还融资回购到期购回款的质押券,若本计划债券回购交收违约,结算公司有权依法对质押券进行处置。

6、未在基金业协会完成备案的风险

本计划成立后需在基金业协会进行备案。即使本计划成立,并不意味着本计划必然能获得基金业协会的备案。而该等备案过程可能会受到相应监管政策的影响,包括备案时间所需时间、能否通过备案都存在一定的不确定性。

如果在计划成立后不能及时完成备案,将可能导致本计划错过市场行情或投资机会;如本资产管理计划备案信息、材料经补正后仍不符合基金业协会要求,则可能面临根据基金业协会的要求进行整改规范,如无法完成整改或各方未能达成一致的,则资产管理人有权提前终止本计划,届时资产管理人将对资产管理计划进行清算,资产管理计划财产可能产生投资损失或丧失其他投资机会,由此直接影响资产委托人参与本计划的投资目的。

7、本计划展期或提前终止的风险

若发生资产管理合同约定展期或提前终止情形时,将可能导致资产委托人无法按照预期安排委托财产投资或无法按时收回委托财产或委托财产收回金额不及预期等风险。

8、资产管理计划份额转让所涉风险

资产管理计划份额可能不具备活跃的转让市场,资产管理计划份额转让受限于交易场所规则、资产管理人与交易场所的系统对接情况、市场主体的参与情况等诸多因素,上述因素都可能导致投资者届时可能无法顺利及时转让其所持有的计划份额。资产管理合同关于资产管理计划份额转让的约定,不代表投资者最终一定能实现计划份额的转让。另外,计划份额转让须遵守交易场所的相关规定及要求,并按资产管理人的规定办理份额变更登记手续,在办理该等份额转让过程中,投资者须履行相关程序性要求并不排除需要支付相关份额转让费用。

9、资产管理合同与基金业协会合同指引不一致所涉风险

基金业协会针对集合资产管理计划资产管理合同的内容及格式发布了《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》（以下简称“合同指引”）。

资产管理合同虽然在合同指引的基础上拟定，但合同指引主要为概括性、原则性约定，因此资产管理合同具体条款的约定可能比合同指引更为复杂、更为具体，也可能与合同指引不完全相同。

投资人应当认真阅读资产管理合同，理解资产管理合同的全部条款，独立做出是否签署资产管理合同的决定。

10. 资产管理计划委托募集所涉风险

资产管理人委托取得基金销售业务资格的机构募集本计划，代销机构可能存在违法违规地公开宣传资产管理计划、误导投资者购买与其风险承受能力不相符合的产品等行为，代销机构的违法违规行为可能导致投资者合法权益受损。投资者同意，因代销机构违法违规、未履行投资者适当性管理义务或者因代销机构自身原因导致投资者损失的，应由代销机构承担相应责任。

12. 通过第三方基金销售机构投资开放式基金的风险

本资产管理计划若通过第三方基金销售机构投资开放式基金，可能会存在认（申）购、赎回（现金分红）基金时资金被挪用的风险；第三方销售平台对基金账户管理不当造成投资人持有基金份额不准确的风险；认（申）购款未能用于购买指定基金的风险等。

13. 电子合同签署风险

若资产管理合同等法律文件采用电子形式签署，则存在使用电子信息系统的固有网络风险，如以资产委托人名义发出的电子指令操作均视为其本人/机构的行为，任何人不得以其采用数据电文的形式，或非本人/机构操作等为理由而否

定已签署资产管理合同等法律文件的法律效力。资产委托人承诺自愿承担电子签名操作的一切后果,并将安全妥善保管赖以完成电子签名操作的自身身份验证信息。

(三) 其它风险

1、战争、自然灾害、法律法规或监管政策变更等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致委托财产的损失。

2、金融市场危机、行业竞争、代理商违约等超出资产管理人自身直接控制能力之外的风险,也可能导致资产委托人利益受损。

3、法律法规、监管政策、业务规则发生变更的风险。本计划存续期限内,立法机构、监管机构、行业协会、交易所、证券登记结算机构等可能对现行有效的法律、法规、规章、规范性文件、监管政策、行业规定、自律规则、业务规则等进行调整、修订、增删、废止、解释,或发布新的监管规范、行业规定等,则资产管理合同及本计划的运作可能需进行相应的调整甚至提前终止。

二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算

(一) 资产管理合同的变更的条件及程序

1、各方一致同意,以下事项可由资产管理人自行决定变更:

(1) 调低资产管理人的报酬标准;

(2) 调整(包括调低和调高)业绩报酬计提基准;

(3) 调低参与费、退出费的费率;

(4) 投资经理的变更;

(5) 对本资产管理计划的认购、参与、退出、资产管理计划份额转让的业

务规则(包括但不限于总规模、单个投资者首次认购、参与金额及持有的本资产管理计划总金额限制等)进行调整。

管理人应于上述事项变更后内容及时向投资者披露,并将相关公告以邮件形式告知资产托管人。

2、各方一致同意,以下事项可由资产管理人和资产托管人协商后变更:

(1) 调低资产托管人或投资顾问(如有)的报酬标准;

(2) 因法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、要求发生变化或根据基金业协会备案需要变更本资产管理合同;

(3) 不会对资产管理计划份额持有人权利义务产生重大实质不利影响的资产管理合同相关事项变更;

(4) 法律法规规定或本资产管理合同约定的其他情形。

3、除前文第1项、第2项所述之外的其余事项如需发生变更,由全体当事人协商一致决定。

资产管理人应当合理保障合同变更后投资者选择退出资产管理计划的权利。

资产管理合同发生变更的,资产管理人应当自资产管理合同变更之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案。

(二) 发生以下事项需要变更合同的处理方式、披露方式以及合同当事人的权利及义务:

1、资产管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产,资产管理计划由其他资产管理人承接;发生此等情形时,原资产管理人应当向新的资产管理人交接本资产管理计划资产管理事务,并以公告形式向资产委托人披露,保障委托人选择退出资产管理计划的权利。

2、资产托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他资产托管人承接。发生此等情形时，原资产托管人应当向新的资产托管人交接本资产管理计划资产托管事务，并以公告形式向资产委托人披露，保障委托人选择退出资产管理计划的权利。

（三）资产管理计划展期应符合以下条件：

- 1、资产管理计划运作规范，资产管理人、资产托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和资产管理合同的约定；
- 2、资产管理计划展期没有损害投资者利益的情形；
- 3、中国证监会规定的其他条件；

资产管理计划展期的，应当符合资产管理计划的成立条件。

（四）资产管理计划终止的情形，包括但不限于下列事项：

- 1、资产管理计划存续期届满且不展期；
- 2、经全体投资者、资产管理人和资产托管人协商一致决定终止的；
- 3、资产管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的资产管理人承接；
- 4、资产托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的资产托管人承接；
- 5、持续五个工作日投资者少于 2 人的；
- 6、未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形；
- 7、法律、行政法规、中国证监会规定及资产管理合同约定的其他情形。

资产管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案（前述第 6 项约定的情形除外）。

（五）资产管理计划财产清算小组

1、自资产管理计划终止情形发生之日起 5 个工作日内，资产管理人应组织成立清算小组。

2、资产管理计划财产清算小组成员由资产管理人、资产托管人组成。清算小组可以聘请必要的工作人员。

3、资产管理计划财产清算小组负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配，可以依法进行必要的民事活动。

（六）资产管理计划财产清算的程序

1、资产管理计划终止后，由清算小组统一接管资产管理计划财产；

2、清算小组对资产管理计划资产进行清理和确认；

3、对资产管理计划资产进行估价；

4、对资产管理计划资产 进行变现；

5、进行资产管理计划剩余资产的分配；

6、制作清算报告；

7、参加与资产管理计划财产有关的民事诉讼（若有）；

8、在资产管理计划清算完毕后五个工作日内将清算结果报证券投资基金业协会备案。

9、清算报告报证券投资基金业协会后的 5 个工作日内，将资产管理计划清算结果通知投资者。

（七）清算费用

清算费用是指清算小组在进行资产管理计划清算过程中发生的以下合理费用，包括但不限于：

- 1、资产管理计划资产的保管、清理、估价、变现和分配产生的费用；
- 2、诉讼仲裁所发生的费用；
- 3、其他与清算事项相关的费用。

清算费用由清算小组从本计划资产中列支。

(八) 资产管理计划清算剩余财产的分配

- 1、资产管理计划财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿管理费、托管费等资产管理计划债务；
- (4) 按投资者持有的计划份额比例进行分配。

资产管理计划财产按前款(1) - (3)项规定清偿后，按资产管理计划投资者持有的计划份额比例进行分配，同时收取业绩报酬，本合同另有约定的除外。

2、除本合同各方当事人另有约定外，资产管理计划终止后财产移交采取现金方式。资产托管人根据资产管理人的指令将资产管理计划财产划至指定账户。

在合同终止后，资产管理计划财产因参加新股申购或持有股票休市、停牌等情况无法变现，对该部分暂时不能变现的资产管理计划财产，资产管理人与资产托管人清算期间不再计提管理费、托管费。资产管理人应在剩余资产管理计划财产变现后5个工作日内向资产托管人发送指令，资产托管人在3个工作日内按指令将剩余资产管理计划财产划至指定账户。

根据中国结算的规定，清算备付金、结算保证金账户内的资金按市场规则每月调整，因此清算备付金、结算保证金账户内的资金、利息需等中国结算退款后

方可清算。该笔清算资金在扣除相关费用后划往指定账户。

在资产管理计划财产移交前，由资产托管人负责保管。保管期间，任何当事人均不得运用该资产管理计划财产。保管期间产生的收益归资产管理计划财产所有，发生的保管费用由资产管理计划财产承担。因投资者原因导致资产管理计划财产无法转移的，资产托管人和资产管理人可以在协商一致后按照有关法律法规进行处理。

资产管理计划财产清算工作结束，并全部划入指定账户后，资产管理人应书面通知资产托管人，尽快完成托管资金账户的销户工作，并将销户结果通知资产管理人。如因本合同相关当事人故意拖延等行为造成销户不及时而出现直接损失或造成相关费用，应当对各自行为承担赔偿责任。

（九）资产管理计划延期清算处理方式

资产管理计划因资产管理计划财产流动性受限等原因延期清算的，资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。

（十）资产管理计划财产清算报告的告知安排

清算报告报证券投资基金业协会后的 5 个工作日内，将资产管理计划清算报告通知投资者。

（十一）资产管理计划财产清算账册及文件的保存

资产管理人、资产托管人等机构应当按照法律法规、监管机构及自律组织的规定保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，任何人不得隐匿、伪造、篡改或者销毁。保存期限自资产管理计划终止之日起不少于二十年。

（十二）资产管理计划财产相关账户的注销

资产管理计划财产清算完毕后,资产托管人按照规定注销资产管理计划财产的资金账户、证券账户等投资所需账户,资产管理人应给与必要的配合。

二十六、反洗钱

1、资产管理人和资产托管人应按照所在国家/地区反洗钱和反恐怖融资方面的法律法规和监管要求,建立健全洗钱和恐怖融资风险管理体系,建立并有效执行反洗钱和反恐怖融资内部控制制度,设立反洗钱和反恐怖融资专门机构或者指定内设机构负责反洗钱和反恐怖融资工作,建立健全和执行客户身份识别、客户身份资料和交易记录保存制度、大额交易和可疑交易监控和报告制度、洗钱和恐怖融资风险自评估制度、反恐怖融资管理机制、制裁筛查机制等相关制度,依法执行联合国安理会制裁决议或国际金融制裁相关要求,开展反洗钱和反恐怖融资内部审计,做好境外洗钱和恐怖融资风险管控和合规经营工作,做好跨境业务的洗钱风险、制裁风险和恐怖融资风险防控,制定反洗钱和反恐怖融资培训制度,开展反洗钱和反恐怖融资宣传,并对可疑客户及可疑交易及时采取有效的风险管控措施。

资产管理人和资产托管人应在符合相关法律法规和监管要求的前提下,共同推进反洗钱和反恐怖融资的合作,为调查涉嫌洗钱、恐怖融资或其他违法犯罪活动提供必要协助。资产管理人和资产托管人应为其自对方获得的与反洗钱和反恐怖融资相关的信息严格保密。如果资产托管人发现资产管理人在协议期间被列入国际组织、当地监管或有关外国政府的制裁名单或制裁范围,或资产托管人发现资产管理人客户及业务涉嫌洗钱和恐怖融资、核武器扩散、国内/国际制裁违规或其他违法犯罪活动,或属于资产托管人拒绝接受的客户,资产托管人有权中止

或拒绝办理相关业务。

对于因一方的任何与反洗钱和反恐怖融资直接相关的作为(或不作为)而导致第三方对另一方进行任何调查、索赔、请求、收费、控告的,该方应赔偿另一方因该等调查、索赔、请求、收费和控告所遭受的直接损失并使其免受直接损失(包括但不限于任何法律成本和费用)。

2、具有下列情形之一的,资产托管人有权拒绝提供托管服务或通过其他形式终止与资产管理人的托管业务关系:

(1)投资者或资产管理人属于被联合国、中国或其他司法管辖区有权机关发布名单实施制裁的人员及实体;

(2)投资者或资产管理人从事洗钱、恐怖融资或其他违法犯罪行为被司法机关定罪量刑;

(3)投资者或资产管理人涉嫌洗钱、恐怖融资或其他违法犯罪行为被诉讼或调查,并使资产托管人遭受或可能遭受巨大声誉、财务等损失;

(4)有合理理由怀疑投资者或资产管理人涉嫌洗钱、恐怖融资或其他违法犯罪行为,要求投资者或资产管理人提供证明交易合法性、真实性等相关材料,投资者或资产管理人无合理理由拒绝配合;

(5)投资者所提供的身份证件、签证等相关证件经核查或鉴定为虚假证件,或为冒用他人身份证件的人员;

(6)当地监管或托管人行内反洗钱及金融制裁合规政策规定的其他情形;

(7)资产托管人认可的其他情形。

二十七、违约责任

(一) 资产管理人、资产托管人在履行各自职责的过程中,违反法律法规规定或者本合同约定,给资产管理计划财产或者投资者造成的直接损失,应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任。但是发生下列情况的,当事人免责:

1、不可抗力;

2、资产管理人和/或资产托管人按照有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等;

3、在没有欺诈或过失的情况下,资产管理人由于按照本合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等;

4、在没有欺诈或过失的情况下,资产托管人由于按照资产管理人的有效指令执行而造成的损失等;

5、资产委托人理解资产管理计划财产的投资、运作、保管面临本合同第二十四章中列举的各类风险,资产管理人及资产托管人就资产管理计划财产面临的上述固有风险免于承担责任;

6、资产管理人及资产托管人对因所引用的投资对象、证券经纪商及其他中介机构提供的信息的真实性、准确性和完整性存在瑕疵,管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现该错误的。

(二) 合同当事人违反本合同,给其他当事人造成的直接损失,应当承担赔偿责任。在发生一方或多方违约的情况下,本合同能继续履行的应当继续履行。

(三) 本合同当事人一方造成违约后,其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大;没有采取适当措施致使损失扩大的,不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

二十八、争议的处理

对于因本合同的订立、内容、履行和解释或与本合同有关的争议，合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会进行仲裁，仲裁地点为北京。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行资产管理合同规定的义务，维护投资者的合法权益。

本合同受中国法律管辖。

二十九、资产管理合同的效力

(一) 本合同是约定合同当事人之间权利义务关系的法律文件。投资者为法人或其他组织，本资产管理合同经投资者、资产管理人和资产托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人(负责人)或授权代理人签字或盖章之日起成立；如投资者为自然人，本资产管理合同经投资者本人签字或授权的代理人签字、资产管理人和资产托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人(负责人)或授权代理人签字或盖章之日起成立。若本合同采用电子签约方式的，本合同经资产管理人和资产托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人(负责人)或法定代表人(负责人)授权的代理人签字或盖章后，自资产委托人按约定的电子签名方式签署本合同之日起成立。

(二) 如本合同采用电子签约方式，本合同由资产管理人和资产托管人加盖公章或合同专用章以及法定代表人(负责人)或法定代表人(负责人)授权的代

理人签字或盖章后制作成样本合同，样本合同一式三份，资产管理人和资产托管人各执一份，其余一份用于开立资产管理计划相关账户，每份均具有同等的法律效力。样本合同扫描件报基金业协会备案。

委托人、管理人、托管人三方认可通过电子合同管理系统安全认证产生的交易行为以及相关交易和记录的有效性、合法性、安全性。因电子合同管理系统自身系统失误造成的任何信息泄露或资金损失、责任的，资产管理人和资产托管人不承担责任。

资产委托人通过电子形式签署资产管理合同、风险揭示书、资产委托人承诺书等法律文件的，即表明资产委托人完全接受资产管理合同、风险揭示书、资产委托人承诺书等法律文件项下的全部条款，与资产委托人签署纸质版资产管理合同、风险揭示书、资产委托人承诺书等法律文件具备同等法律效力，资产委托人受资产管理合同、风险揭示书、资产委托人承诺书等法律文件约束。资产委托人通过身份验证等方式登录指定的网络系统，确认同意接受电子形式资产管理合同、风险揭示书或其他文书的，即视为资产委托人已签署资产管理合同、风险揭示书或其他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等法律效力，无须另行签署纸质合同或纸质风险揭示书或其他文书。

（三）本资产管理计划的募集金额缴足之日起十个工作日内，由资产管理人公告资产管理计划成立。资产管理人公告本计划成立之日起，资产管理合同生效。如投资者系本计划运作期间参与到本计划的，则资产管理合同自各方当事人依据上述要求签署之日起生效。

（四）本合同自生效之日起对投资者、资产管理人、资产托管人具有同等的法律约束力。资产委托人通过代理销售机构以电子形式签署本合同的，与资产委

托人签署纸质版资产管理合同具备同等法律效力，资产委托人均受本合同约束。

(五) 本合同有效期为自本合同生效之日起至满 120 个月的对日止（若该日非交易日的，顺延至下一交易日）。计划终止后，资产管理人、资产托管人应继续履行法律法规及本合同规定的清算职责。

(六) 本资产管理计划成立之日起 5 个工作日内，资产管理人将本合同、投资者名单与认购金额资产缴付证明等材料报证券投资基金业协会备案。

(七) 投资者自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。在资产管理计划存续期间，投资者自全部退出资产管理计划之日起，不再成为资产管理计划的投资者和资产管理合同的当事人。

三十、其他事项

如中国证监会对资产管理合同的内容与格式有新要求并适用于本合同的，投资者、资产管理人和资产托管人应立即展开协商，根据中国证监会的相关要求修改本合同的内容和格式。

本合同如采用套印形式进行印刷，资产管理人应要求印刷厂严格按照经资产管理人和资产托管人最终签署的合同样版进行批量印刷。按合同样版的内容及印模印刷的合同视为经资产管理人和资产托管人有效签署的合同。资产管理人确保，合同套印件仅作为与资产委托人签署并约定“华夏基金龙腾稳健 1 号集合资产管理计划”投资管理事项使用。资产委托人特此声明：其独立、自主、谨慎作出投资决策并签署本合同，同时认可资产管理人和资产托管人依照“二十九、资产管理合同的效力（一）”款规定签署后以套印方式印刷的合同具有法律效力，委托人按照“二十九、资产管理合同的效力（一）”款规定签署合同套印件后本合同

即成立。

本合同项下应由资产托管人向投资者、资产管理人出具与托管业务运营相关的报表、报告。往来函件及其他相关资料应加盖的印章，资产托管人指定为“中国建设银行股份有限公司上海市分行业务专用章（资产托管）（1）”印章。本合同如有未尽事宜，由合同当事人各方按有关法律法规的规定协商解决。

本产品根据托管协议等约定，定期由管理人与托管人进行会计估值对账，因此授权托管人代表本产品与开户银行办理银企对账事宜。

（以下无正文）

（本页为《华夏基金龙腾稳健1号集合资产管理计划资产管理合同》签署页，请投资者务必确保填写的资料正确有效，如因填写错误导致的任何损失，资产管理人和资产托管人不承担任何责任）

投资者请填写：

1、自然人

姓名：

证件类型：

证件号码：

住所：

联系电话：

通讯地址：

投资者授权之代理人（如有）：

代理人身份证件类型：

证件号码：

住所：

联系电话：

通讯地址：

2、法人或其他组织

名称：

营业执照号码：

组织机构代码证号码：

法定代表人或授权代理人：

住所：

联系电话：



(本页无正文,为《华夏基金龙腾稳健 1 号集合资产管理计划资产管理合同》
签署页)

投资者:(签字或公章或合同专用章)

法定代表人(负责人)或授权代理人:

资产管理人:华夏基金管理有限公司(公章或合同专用章)

法定代表人(负责人)或授权代理人:

2023.9.20

资产托管人:中国建设银行股份有限公司上海市分行(公章或合同专用章)

法定代表人(负责人)或授权代理人:

2023 年 9 月 20 日
签署日期:二〇 年 月

附件一：华夏基金龙腾稳健1号集合资产管理计划托管账户指令（样本）

华夏基金管理有限公司基金划款指令书（**）

付款日期： *年*月*日

中国**银行北京：

敬请根据以下提供的收款人名称、开户行、账号、到账日期和划款金额划款。

到账日期：			
收款方户名：			
开户行：			
账 号：			
大额支付号：		联行行号：	
划款金额(小写)：			
划款金额(大写)：			
业务类型：			
交易日期：			
付款方	付款方户名：		
	开户行：		
	账 号：		
	大额支付号：		联行行号：
划款用途：			
备注：			
管理人签章：	托管人签章：		
审批人：	审批人：		
复核人：	复核人：		
经办人：	经办人：		

制作日期：

附件二：划款指令授权书（样本）

划款指令授权书（授权通知）

中国建设银行股份有限公司上海市分行：

本公司决定授权以下人员负责向贵行发送本公司在贵行托管的所有投资组合的投资指令，投资指令授权的相关情况如下：

注：以下任意两人分别为制单、复核即可。

人员	授权范围	签名样本	盖章样本
	制单、复核		
	制单、复核		
	制单、复核		
	制单、复核		
	制单、复核		

人员	授权范围	签名样本	管理人签章
	审批		

注：以上制单、复核、审批的签名或盖章与管理人签章须同时使用，指令方为有效。

自即日起，请贵行以本授权书为准，对指令进行审查。如有人员变更，请以本公司更新后的授权书为准。

华夏基金管理有限公司

（公章）

2023 年*月*日

附件三：业务联系表

**公司			
邮寄地址：			
邮政编码：			
岗位	姓名	电话	电子邮箱
资产管理人指定向资产托管人发送划款指令的指定邮箱如下： 1. _____；2. _____； 3. _____；4. _____； 以上指定邮箱作为资产托管人识别资产管理人的依据之一，若资产管理人非由指定邮箱向资产托管人发送的划款指令，资产托管人有权拒绝执行，并不承担由此引起的一切责任。若资产管理人变更指定邮箱，由资产管理人向资产托管人发送加盖资产管理人公章或预留印章的《业务联系表》，指定邮箱的变更自资产托管人收到《业务联系表》之日起生效。			

托管人业务联系表及授权书

以下授权的期限同本资产管理合同有效期限。

业务联系部门：中国建设银行股份有限公司上海市分行资产托管业务中心

办公地址：上海市淮海中路200号7楼 邮政编码：200021 电话总机：021-63181818

划款指令接收传真号码：021-38130168，指令接收邮箱：tgzljz@vip.ccb.com

接收数据专用深圳通小站号：K0252

核算人员A角：庄韵捷

姓名	分机	传真	直线、手机	客户服务岗位说明
马伟琪	8753	63861711 或 63867171 或 63870131	13621883030	清算岗位
张晓莹	8773		13764288462	清算岗位
王洁	8783		13917721031	清算岗位
章军	8733		13817245578	清算岗位
沈晓玲	8763		13801696394	清算岗位、银行间债券交割
秦军	8713		13817582695	清算岗位兼资产托管营运协调人

黄海	8722	13701958062	核算岗位兼资产托运营协调人
庄韵捷	8742	15921505651	核算岗位
马文华	8738	13816390707	核算岗位
施亮禹	8752	13641930867	核算岗位
应茹佳	8778	13918259030	核算岗位
马连杰	8772	15000095306	核算岗位
张涵钦	8788	15801783767	监督岗位
刘雯	8748	13818006480	监督岗位兼监督协调人

华夏基金管理有限公司
2023-09-19&wangjy